

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de julio de 2024
Fecha de Información: 03 de julio de 2024¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$3597 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.88%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

| Rango | Sector Financiero ² | | Intragrupo y Off-shore ³ | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 582,3 | 717,3 | 408,4 | 265,3 | 24,8 | 33,0 | 284,0 |
| 15-35 | 1006,7 | 1548,1 | 838,7 | 208,6 | 49,9 | 138,5 | 659,5 |
| 36-60 | 38,2 | 121,6 | 80,0 | 0,0 | 21,6 | 18,2 | 20,0 |
| 61-90 | 99,0 | 285,1 | 205,9 | 42,3 | 24,2 | 1,7 | 55,0 |
| 91-180 | 124,1 | 70,5 | 19,7 | 94,8 | 25,9 | 4,3 | 25,0 |
| >180 | 33,5 | 19,0 | 12,0 | 13,0 | 2,0 | 15,5 | 5,0 |
| Total | 1883,8 | 2761,6 | 1564,6 | 624,0 | 148,4 | 211,3 | 1048,5 |

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| Rango | Intermediarios del Mercado Cambiario ¹ | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|---|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 6.24% | 6.34% | 5.21% | 5.94% |
| 15-35 | 6.26% | 5.90% | 5.09% | 5.90% |
| 36-60 | 6.15% | 6.06% | 5.92% | 6.05% |
| 61-90 | 5.37% | 5.69% | 5.63% | 5.60% |
| 91-180 | 5.71% | 5.80% | 5.69% | 5.73% |
| >180 | 5.31% | 5.66% | 5.12% | 5.20% |
| Total | 6.19% | 5.90% | 5.21% | 5.88% |

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

²El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

³Cifras en millones de dólares

²Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

³Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

¹Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 01 – 05 jul. | | | | 08 - 12 jul. | | | | 15 - 19 jul. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 153 | 83 | 3570 | 5247 | 150 | 121 | 8148 | 9896 | 165 | 129 | 7157 | 7363 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3686 | 1930 | 0 | 0 | 5483 | 3161 | 0 | 0 | 3960 | 2491 |
| Otros ^c | 83 | 153 | 125 | 203 | 121 | 150 | 1071 | 1555 | 129 | 165 | 629 | 1871 |
| Total | 236 | 236 | 7381 | 7380 | 271 | 271 | 14702 | 14612 | 294 | 294 | 11746 | 11725 |

^a Cifras en millones de dólares.

^b Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

^c Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes