

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de julio de 2024
Fecha de Información: 04 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\$227 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.63%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	15,4	13,1	7,7	14,5	5,4	0,9	0
15-35	26,8	39,2	35,3	23,2	0,9	0,5	3
36-60	0,2	3,8	0,0	0,0	3,8	0,2	0
61-90	59,4	1,0	0,0	58,9	1,0	0,5	0
91-180	0,0	61,8	58,8	0,0	3,0	0,0	0
>180	7,3	2,1	1,8	4,5	0,3	2,8	0
Total	109,1	121,1	103,6	101,2	14,5	4,9	3

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	–	6.16%	4.22%	4.85%
15-35	6.01%	6.36%	4.95%	5.86%
36-60	–	6.36%	5.20%	6.30%
61-90	–	5.37%	5.79%	5.51%
91-180	–	7.12%	–	7.12%
>180	–	5.86%	5.16%	5.22%
Total	6.01%	6.35%	4.66%	5.63%

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	18	49	849	1590	151	121	8241	9945	166	129	7158	7394
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1051	278	0	0	5529	3252	0	0	3990	2491
Otros ^c	49	18	70	101	121	151	1074	1557	129	166	630	1872
Total	67	67	1970	1969	272	272	14844	14754	295	295	11778	11757

^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