

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de julio de 2024
Fecha de Información: 05 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\$3600 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.62%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	922,6	1148,3	704,8	745,4	311,6	45,2	132
15-35	593,3	664,5	324,6	255,0	27,9	26,3	312
36-60	97,7	12,9	0,0	0,0	12,9	97,7	0
61-90	272,4	85,7	62,6	40,0	13,1	222,4	10
91-180	23,1	136,5	124,3	1,7	12,2	21,4	0
>180	45,4	52,1	19,4	22,3	32,7	23,1	0
Total	1954,4	2100,0	1235,6	1064,4	410,4	436,0	454

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	6.37%	4.06%	5.10%	4.72%
15-35	6.38%	6.31%	6.36%	6.35%
36-60	–	6.26%	6.27%	6.27%
61-90	5.98%	5.90%	5.57%	5.64%
91-180	–	5.75%	5.43%	5.70%
>180	–	5.29%	5.27%	5.28%
Total	6.37%	5.16%	5.75%	5.62%

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	17	48	851	1590	171	125	8559	10924	171	130	7188	7499
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1051	278	0	0	6092	3438	0	0	4062	2491
Otros ^c	48	17	69	103	125	171	1358	1557	130	171	654	1892
Total	65	65	1971	1971	296	296	16009	15919	301	301	11904	11882

^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