

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2024
Fecha de Información: 09 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\$4290 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.73%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 | 1000,6 | 746,0 | 172,8 | 738,8 | 349,6 | 38,3 | 223,5 |
| 15-35 | 716,9 | 1436,0 | 1018,0 | 258,2 | 33,1 | 73,9 | 384,8 |
| 36-60 | 172,2 | 135,9 | 1,2 | 0,0 | 20,3 | 57,8 | 114,4 |
| 61-90 | 312,3 | 69,6 | 50,0 | 38,3 | 19,6 | 274,0 | 0,0 |
| 91-180 | 115,2 | 110,2 | 34,5 | 50,0 | 40,7 | 30,2 | 35,0 |
| >180 | 85,4 | 182,0 | 137,9 | 48,1 | 9,1 | 2,4 | 35,0 |
| Total | 2402,7 | 2679,7 | 1414,5 | 1133,4 | 472,4 | 476,6 | 792,7 |

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 | 6.22% | | 3.40% | 6.22% | 5.25% |
| 15-35 | 6.21% | | 6.22% | 6.22% | 6.22% |
| 36-60 | 6.15% | | 6.36% | 6.07% | 6.15% |
| 61-90 | - | | 5.91% | 5.41% | 5.50% |
| 91-180 | 5.80% | | 5.86% | 5.64% | 5.76% |
| >180 | 5.50% | | 5.53% | 5.13% | 5.51% |
| Total | 6.16% | | 5.24% | 6.01% | 5.73% |

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 | 08 – 12 jul. | | | | 15 - 19 jul. | | | | 22 - 26 jul. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 167 | 110 | 8973 | 10098 | 181 | 144 | 7628 | 8242 | 182 | 179 | 5296 | 6676 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 5448 | 4021 | 0 | 0 | 4264 | 2651 | 0 | 0 | 4059 | 2007 |
| Otros ^c | 110 | 167 | 1393 | 1606 | 144 | 181 | 993 | 1950 | 179 | 182 | 421 | 1047 |
| Total | 277 | 277 | 15814 | 15725 | 325 | 325 | 12885 | 12843 | 361 | 361 | 9776 | 9730 |

^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