

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2024
Fecha de Información: 11 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\$2908 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.57%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	694,4	350,0	210,0	475,9	35,0	113,4	105,0
15-35	442,0	726,3	498,7	261,3	130,7	83,8	96,9
36-60	2,7	85,9	64,0	0,0	21,9	2,7	0,0
61-90	80,8	231,3	167,2	2,0	24,1	38,8	40,0
91-180	307,6	276,6	123,9	160,0	37,7	32,6	115,0
>180	57,6	63,9	3,0	0,0	6,9	3,6	54,0
Total	1585,0	1734,2	1066,9	899,2	256,4	274,9	410,9

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	5.87%	5.98%	5.23%	5.51%
15-35	5.82%	5.88%	5.24%	5.71%
36-60	—	5.85%	5.79%	5.85%
61-90	5.66%	4.96%	5.46%	5.24%
91-180	5.65%	5.63%	4.75%	5.49%
>180	5.29%	5.58%	5.20%	5.33%
Total	5.70%	5.79%	5.22%	5.57%

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	88	63	4739	4709	187	152	8196	8886	184	183	5334	6854
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2818	2667	0	0	4596	2958	0	0	4193	2007
Otros ^c	63	88	208	321	152	187	1164	2070	183	184	442	1061
Total	151	151	7765	7697	339	339	13956	13914	367	367	9969	9922

^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