

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2024
Fecha de Información: 15 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\$3594 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.67%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	1074,5	267,9	46,5	943,7	102,8	12,2	118,6
15-35	578,3	1250,6	1159,2	373,0	18,3	132,3	73,0
36-60	160,6	42,4	25,0	102,5	17,4	58,1	0,0
61-90	21,0	14,4	0,0	20,4	14,4	0,6	0,0
91-180	136,0	192,9	140,3	75,0	12,7	21,0	40,0
>180	56,5	41,7	20,0	0,0	10,7	45,5	11,0
Total	2026,9	1810,0	1391,0	1514,7	176,4	269,6	242,6

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	5.99%	5.69%	5.69%	5.73%
15-35	5.90%	5.96%	5.10%	5.71%
36-60	–	5.98%	5.71%	5.81%
61-90	–	5.98%	5.70%	5.97%
91-180	5.73%	4.94%	5.50%	5.18%
>180	5.33%	5.46%	4.92%	5.16%
Total	5.89%	5.82%	5.46%	5.67%

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	15 – 19 jul.				22 - 26 jul.				29 jul. - 02 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	197	159	9201	9585	194	186	5872	7084	204	248	5816	7679
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4757	3581	0	0	4234	2454	0	0	4740	2228
Otros ^c	159	197	1475	2224	186	194	547	1068	248	204	717	1333
Total	356	356	15433	15390	380	380	10653	10606	452	452	11273	11240

^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