

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de julio de 2024
Fecha de Información: 16 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\$3592 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.81%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 | 995,5 | 783,9 | 183,5 | 364,4 | 68,2 | 98,9 | 532,2 |
| 15-35 | 917,1 | 1080,5 | 632,7 | 412,0 | 8,8 | 66,1 | 439,0 |
| 36-60 | 21,4 | 8,5 | 0,0 | 0,0 | 7,9 | 20,8 | 0,6 |
| 61-90 | 283,5 | 128,4 | 20,0 | 160,0 | 7,9 | 23,0 | 100,5 |
| 91-180 | 116,2 | 331,7 | 230,0 | 0,0 | 6,7 | 21,2 | 95,0 |
| >180 | 91,6 | 92,2 | 0,0 | 0,0 | 1,1 | 0,5 | 91,2 |
| Total | 2425,4 | 2425,2 | 1066,2 | 936,4 | 100,5 | 230,5 | 1258,5 |

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 | 6.02% | 6.04% | 4.89% | 5.68% |
| 15-35 | 6.02% | 5.89% | 5.97% | 5.96% |
| 36-60 | 5.68% | 5.99% | 5.67% | 5.76% |
| 61-90 | 5.71% | 5.94% | 5.76% | 5.76% |
| 91-180 | 5.71% | 5.79% | 5.58% | 5.75% |
| >180 | 5.36% | 5.32% | 4.94% | 5.36% |
| Total | 5.93% | 5.90% | 5.52% | 5.81% |

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 | 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 | 131 | 117 | 6480 | 6740 | 259 | 205 | 6308 | 7469 | 205 | 248 | 6051 | 7878 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3017 | 2418 | 0 | 0 | 4370 | 2679 | 0 | 0 | 4800 | 2321 |
| Otros ^c | 117 | 131 | 1078 | 1395 | 205 | 259 | 601 | 1085 | 248 | 205 | 723 | 1341 |
| Total | 248 | 248 | 10575 | 10553 | 464 | 464 | 11279 | 11233 | 453 | 453 | 11574 | 11540 |

^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