

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2024
Fecha de Información: 17 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\$2807 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.98%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	1036,7	591,8	237,0	598,0	11,7	95,7	343,0
15-35	637,1	1109,6	688,0	160,0	26,1	81,5	395,6
36-60	9,9	22,2	1,2	0,0	21,1	9,9	0,0
61-90	11,2	4,5	0,0	0,7	4,5	10,6	0,0
91-180	2,5	34,3	20,0	0,0	14,3	2,5	0,0
>180	64,5	42,4	10,0	35,0	10,9	8,0	21,5
Total	1762,0	1804,7	956,2	793,6	88,4	208,3	760,1

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	6.18%	4.66%	5.81%	5.71%
15-35	6.27%	6.28%	6.17%	6.26%
36-60	–	6.21%	5.93%	6.12%
61-90	–	6.02%	5.83%	5.89%
91-180	–	6.02%	5.24%	5.94%
>180	5.27%	5.47%	4.93%	5.27%
Total	6.20%	5.88%	5.89%	5.98%

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	102	106	4847	4979	274	207	6680	7659	207	242	6256	8103
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2214	1864	0	0	4473	2918	0	0	4850	2341
Otros ^c	106	102	633	836	207	274	603	1133	242	207	732	1360
Total	208	208	7694	7679	481	481	11756	11710	449	449	11838	11804

^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