

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2024
Fecha de Información: 19 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\$4468 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.79%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	727,1	959,1	334,6	361,9	339,5	80,2	285,0
15-35	839,4	758,8	436,8	446,8	15,6	86,2	306,5
36-60	2,2	9,0	0,0	0,0	9,0	2,2	0,0
61-90	250,5	223,8	134,8	0,0	33,9	195,5	55,0
91-180	230,4	239,8	204,5	80,0	12,8	127,9	22,5
>180	777,9	823,6	118,1	71,0	0,5	1,9	705,0
Total	2827,5	3014,1	1228,8	959,7	411,3	493,8	1374,0

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	6.55%	5.03%	4.82%	5.30%
15-35	6.58%	6.40%	6.44%	6.47%
36-60	—	6.46%	5.93%	6.36%
61-90	6.28%	6.14%	5.79%	5.98%
91-180	6.12%	6.04%	6.06%	6.05%
>180	5.42%	5.45%	5.20%	5.42%
Total	5.96%	5.71%	5.68%	5.79%

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

Sector	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	27	41	455	522	310	212	7414	8703	242	235	6444	8270
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	293	226	0	0	4788	3323	0	0	4905	2405
Otros ^c	41	27	45	45	212	310	1076	1206	235	242	751	1392
Total	68	68	793	793	522	522	13278	13232	477	477	12100	12067

^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