

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2024
Fecha de Información: 22 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\$3650 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.43%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	773,2	601,0	250,1	477,9	120,3	64,7	230,6
15-35	932,5	1045,7	402,9	207,8	16,2	98,2	626,6
36-60	93,2	127,8	24,3	0,0	13,5	3,2	90,0
61-90	2,2	14,1	0,0	0,0	14,1	2,2	0,0
91-180	420,3	458,5	197,5	114,7	26,0	70,6	235,0
>180	341,3	337,1	21,4	26,3	0,7	0,0	315,0
Total	2562,7	2584,3	896,3	826,7	190,8	238,9	1497,2

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	6.23%	6.74%	6.58%	6.53%
15-35	6.71%	6.77%	6.68%	6.72%
36-60	6.52%	6.63%	6.18%	6.52%
61-90	–	6.35%	6.04%	6.31%
91-180	6.14%	6.14%	6.02%	6.12%
>180	5.47%	5.83%	–	5.48%
Total	6.27%	6.63%	6.55%	6.43%

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	22 – 26 jul.				29 jul. - 02 ago.				05 - 09 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	312	214	8220	9158	245	242	6531	8387	207	92	4841	7076
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4991	3775	0	0	4942	2437	0	0	4427	2055
Otros ^c	214	312	1138	1369	242	245	822	1437	92	207	248	339
Total	526	526	14349	14302	487	487	12295	12261	299	299	9516	9470

^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