

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2024
Fecha de Información: 24 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\$3729 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.28%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	783,3	498,7	117,1	590,6	276,6	87,7	105,0
15-35	927,3	989,6	391,9	301,0	31,1	59,7	566,6
36-60	409,3	311,3	0,0	0,0	16,3	114,3	295,0
61-90	278,0	28,2	0,0	39,5	23,2	233,5	5,0
91-180	113,9	244,3	166,7	10,0	7,5	33,9	70,0
>180	23,0	163,8	162,4	17,8	1,4	5,2	0,0
Total	2534,9	2235,9	838,1	959,0	356,2	534,3	1041,6

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	6.91%	5.18%	6.38%	5.94%
15-35	6.58%	6.61%	6.52%	6.57%
36-60	6.40%	6.55%	6.47%	6.43%
61-90	6.28%	6.27%	5.99%	6.02%
91-180	6.21%	6.15%	6.11%	6.16%
>180	–	5.66%	5.29%	5.61%
Total	6.54%	5.96%	6.32%	6.28%

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	247	149	4772	5174	315	239	7068	8944	246	94	4993	7171
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2969	2416	0	0	4989	2809	0	0	4472	2085
Otros ^c	149	247	613	734	239	315	1226	1496	94	246	258	422
Total	396	396	8354	8324	554	554	13283	13249	340	340	9723	9678

^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