

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2024
Fecha de Información: 29 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\$4504 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.33%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragruppo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1588,6	424,0	346,9	1365,3	9,2	155,3	68,0
15-35	497,8	1277,8	1035,1	316,1	123,3	0,0	181,7
36-60	221,9	228,4	90,0	25,5	13,1	71,1	125,3
61-90	3,8	6,1	0,0	0,0	6,1	3,8	0,0
91-180	177,3	256,9	99,9	0,0	27,1	0,0	177,3
>180	266,5	329,8	126,1	44,1	5,7	0,0	222,4
Total	2755,8	2523,1	1697,9	1751,0	184,5	230,2	774,7

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	5.67%	5.60%	4.58%	4.83%
15-35	5.65%	5.63%	5.71%	5.65%
36-60	5.68%	5.80%	5.76%	5.74%
61-90	–	5.94%	5.48%	5.76%
91-180	5.76%	5.79%	5.67%	5.75%
>180	5.30%	5.46%	5.29%	5.34%
Total	5.57%	5.63%	4.90%	5.33%

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	29 jul. - 02 ago.				05 - 09 ago.				12 - 16 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	327	259	9268	9787	409	93	5873	7514	59	145	7478	8368
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5311	4595	0	0	4517	2652	0	0	5170	2457
Otros ^c	259	327	1510	1673	93	409	288	456	145	59	709	2484
Total	586	586	16089	16055	502	502	10678	10622	204	204	13357	13309

^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