

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de julio de 2024
Fecha de Información: 26 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\$3654 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.21%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	886,7	383,1	22,1	662,1	222,5	86,0	138,5
15-35	411,1	957,4	696,7	163,0	18,7	6,1	242,0
36-60	17,7	7,4	0,0	0,7	7,3	16,8	0,1
61-90	124,3	93,0	75,0	92,9	8,0	21,4	10,0
91-180	329,3	129,6	79,1	60,0	10,4	229,3	40,0
>180	536,2	583,1	194,5	148,9	14,2	12,9	374,4
Total	2305,3	2153,6	1067,5	1127,7	281,1	372,5	805,0

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	5.91%	3.58%	4.07%	4.23%
15-35	5.90%	5.53%	5.86%	5.67%
36-60	5.59%	6.42%	6.07%	6.18%
61-90	6.02%	6.02%	5.62%	5.94%
91-180	5.85%	5.93%	5.70%	5.74%
>180	5.41%	5.70%	5.28%	5.42%
Total	5.67%	5.13%	4.91%	5.21%

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	96	46	529	624	323	254	8021	9451	357	93	5746	7473
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	234	137	0	0	5045	3576	0	0	4505	2569
Otros ^c	46	96	86	88	254	323	1510	1516	93	357	281	435
Total	142	142	849	849	577	577	14576	14543	450	450	10532	10477

^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