

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2024
Fecha de Información: 08 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\$2939 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.42%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	758,4	295,2	63,0	577,2	68,2	17,2	164,0
15-35	600,6	1120,6	755,2	240,4	37,4	32,2	328,0
36-60	198,1	201,4	100,4	50,0	31,0	78,1	70,0
61-90	9,2	21,8	0,3	1,0	21,5	8,2	0,0
91-180	75,3	174,0	99,1	0,0	35,0	35,3	40,0
>180	61,0	48,7	19,0	31,5	6,1	6,0	23,5
Total	1702,7	1861,8	1037,0	900,1	199,2	177,0	625,5

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	6.33%	6.59%	2.86%	4.09%
15-35	6.32%	6.15%	6.28%	6.23%
36-60	5.97%	6.04%	5.94%	5.99%
61-90	–	5.91%	5.87%	5.90%
91-180	5.77%	5.78%	5.60%	5.74%
>180	5.38%	5.59%	4.96%	5.34%
Total	6.21%	6.14%	4.14%	5.42%

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	08 – 12 jul.				15 - 19 jul.				22 - 26 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	172	133	9204	11038	175	137	7423	7671	133	177	5277	6601
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6117	3903	0	0	4115	2573	0	0	4005	2007
Otros ^c	133	172	1396	1685	137	175	671	1923	177	133	415	1043
Total	305	305	16717	16626	312	312	12209	12167	310	310	9697	9651

^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