

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de julio de 2024
Fecha de Información: 10 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\$4188 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.76%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	917,0	614,5	386,6	826,1	163,8	26,8	64,1
15-35	839,6	956,7	694,8	515,5	128,9	191,1	133,0
36-60	175,6	57,0	0,0	1,9	46,9	163,6	10,1
61-90	126,6	54,5	0,0	94,7	39,5	16,9	15,0
91-180	91,9	233,7	120,5	0,0	48,2	26,9	65,0
>180	364,8	333,6	39,4	35,6	4,1	39,2	290,0
Total	2515,5	2250,0	1241,3	1473,8	431,5	464,5	577,2

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	6.10%		6.15%	4.96%	5.50%
15-35	6.06%		6.06%	5.97%	6.03%
36-60	5.82%		6.17%	5.83%	5.90%
61-90	5.83%		5.97%	5.76%	5.89%
91-180	5.71%		5.79%	5.54%	5.73%
>180	5.36%		5.74%	5.25%	5.35%
Total	5.66%		6.07%	5.48%	5.76%

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	97	96	7348	7794	184	148	7797	8655	183	182	5310	6823
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4416	3637	0	0	4482	2760	0	0	4183	2007
Otros ^c	96	97	717	968	148	184	1140	1963	182	183	434	1051
Total	193	193	12481	12399	332	332	13419	13378	365	365	9927	9881

^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