

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de agosto de 2024
Fecha de Información: 30 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\$4265 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.53%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupa y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1199,7	378,8	112,2	881,9	4,3	55,5	262,3
15-35	1135,4	1401,6	598,2	413,1	153,8	72,7	649,6
36-60	72,1	417,5	360,3	1,7	22,2	35,4	35,0
61-90	51,9	4,6	0,0	0,0	4,2	51,6	0,4
91-180	296,3	208,3	95,1	100,0	8,2	91,3	105,0
>180	148,1	63,2	0,0	35,0	2,9	52,8	60,3
Total	2903,5	2474,0	1165,8	1431,7	195,7	359,3	1112,5

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	5.73%	5.88%	4.78%	5.23%
15-35	5.61%	5.73%	5.60%	5.65%
36-60	5.69%	5.73%	5.54%	5.71%
61-90	5.60%	5.90%	5.56%	5.59%
91-180	5.57%	5.55%	5.57%	5.56%
>180	5.26%	6.10%	5.11%	5.19%
Total	5.62%	5.73%	5.25%	5.53%

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	225	237	7782	7688	414	103	6103	7633	61	145	7622	8478
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4249	4137	0	0	4548	2790	0	0	5182	2487
Otros ^c	237	225	1196	1385	103	414	291	463	145	61	714	2496
Total	462	462	13227	13210	517	517	10942	10886	206	206	13518	13461

^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