

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de agosto de 2024
Fecha de Información: 31 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\$4430 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.25%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 | 1214,4 | 359,0 | 196,3 | 1006,9 | 65,7 | 110,6 | 97 |
| 15-35 | 980,0 | 1287,1 | 809,4 | 488,4 | 27,7 | 41,6 | 450 |
| 36-60 | 33,0 | 22,7 | 0,0 | 7,8 | 22,7 | 25,2 | 0 |
| 61-90 | 207,7 | 146,3 | 37,8 | 45,0 | 33,5 | 87,7 | 75 |
| 91-180 | 144,7 | 106,1 | 40,5 | 57,5 | 5,6 | 27,2 | 60 |
| >180 | 479,1 | 282,0 | 131,0 | 327,3 | 1,0 | 1,8 | 150 |
| Total | 3058,9 | 2203,2 | 1215,0 | 1932,8 | 156,2 | 294,1 | 832 |

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 | 5.40% | | 5.49% | 4.79% | 4.99% |
| 15-35 | 5.49% | | 5.23% | 5.27% | 5.31% |
| 36-60 | - | | 5.70% | 5.40% | 5.52% |
| 61-90 | 5.41% | | 5.60% | 5.52% | 5.51% |
| 91-180 | 5.56% | | 5.59% | 5.45% | 5.53% |
| >180 | 5.21% | | 5.26% | 5.09% | 5.18% |
| Total | 5.43% | | 5.31% | 5.09% | 5.25% |

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 | 215 | 184 | 7093 | 6712 | 469 | 103 | 6313 | 7651 | 62 | 145 | 8076 | 8871 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3657 | 3910 | 0 | 0 | 4555 | 2947 | 0 | 0 | 5292 | 2662 |
| Otros ^c | 184 | 215 | 1042 | 1170 | 103 | 469 | 296 | 510 | 145 | 62 | 727 | 2505 |
| Total | 399 | 399 | 11792 | 11792 | 572 | 572 | 11164 | 11108 | 207 | 207 | 14095 | 14038 |

^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