

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