

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de agosto de 2024
Fecha de Información: 01 de agosto 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\$4542 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.18%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	563,6	429,6	201,3	316,5	48,2	67,0	180,1
15-35	1442,0	1713,6	742,6	384,1	8,7	95,6	962,3
36-60	73,6	142,8	60,0	0,0	12,8	3,6	70,0
61-90	612,9	574,2	143,5	179,4	4,9	7,8	425,7
91-180	63,0	216,5	159,1	0,0	17,4	23,0	40,0
>180	191,8	276,3	194,0	109,5	2,2	2,3	80,0
Total	2947,0	3352,9	1500,5	989,5	94,3	199,3	1758,1

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	5.10%	5.15%	5.08%	5.11%
15-35	5.14%	5.21%	5.09%	5.15%
36-60	5.17%	5.31%	4.89%	5.23%
61-90	5.34%	5.31%	5.06%	5.33%
91-180	5.31%	5.38%	5.25%	5.34%
>180	5.22%	5.17%	5.19%	5.20%
Total	5.19%	5.23%	5.10%	5.18%

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	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	142	56	4652	4817	513	107	6771	8002	64	146	8262	8994
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2493	2257	0	0	4697	3218	0	0	5329	2742
Otros ^c	56	142	768	838	107	513	339	533	146	64	731	2528
Total	198	198	7913	7912	620	620	11807	11753	210	210	14322	14264

^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