

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2024
Fecha de Información: 09 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\$4053 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.25%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragruppo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	524,0	604,6	285,1	454,9	289,6	39,1	30
15-35	1090,7	1628,0	993,4	400,8	26,6	81,9	608
36-60	49,0	48,5	0,0	0,0	48,5	49,0	0
61-90	235,9	35,9	16,8	42,7	14,1	188,2	5
91-180	31,7	251,4	211,7	0,0	9,7	1,7	30
>180	166,8	109,5	55,3	116,6	4,1	0,2	50
Total	2098,0	2677,9	1562,2	1015,0	392,7	360,0	723

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	5.69%	4.75%	4.78%	4.79%
15-35	5.59%	5.37%	5.48%	5.46%
36-60	—	5.98%	5.59%	5.78%
61-90	5.58%	5.72%	5.10%	5.18%
91-180	5.49%	5.49%	5.33%	5.49%
>180	5.25%	5.51%	5.03%	5.16%
Total	5.57%	5.22%	5.06%	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	05 – 09 ago.				12 - 16 ago.				19 - 23 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	150	40	450	451	103	158	11496	12451	35	138	6873	7001
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	215	161	0	0	6072	4046	0	0	3805	2375
Otros ^c	40	150	36	69	158	103	1590	2603	138	35	709	1981
Total	190	190	701	681	261	261	19158	19100	173	173	11387	11357

^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