

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2024
Fecha de Información: 12 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\$2797 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.45%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	402,6	796,4	428,5	212,0	195,8	18,5	172,1
15-35	639,1	740,0	443,2	307,0	17,8	53,0	279,0
36-60	363,7	134,7	21,0	85,2	12,7	177,5	101,0
61-90	2,9	18,5	0,0	0,0	18,5	2,9	0,0
91-180	75,5	148,5	71,7	0,0	16,8	15,5	60,0
>180	58,7	43,5	26,1	43,1	2,4	0,5	15,0
Total	1542,3	1881,7	990,6	647,3	264,0	267,8	627,1

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	5.64%		5.72%	5.03%	5.49%
15-35	5.60%		5.41%	5.10%	5.39%
36-60	5.55%		5.78%	5.60%	5.60%
61-90	-		5.14%	5.40%	5.18%
91-180	5.48%		5.37%	5.32%	5.41%
>180	5.25%		5.59%	5.24%	5.26%
Total	5.58%		5.52%	5.22%	5.45%

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	12 – 16 ago.				19 - 23 ago.				26 - 30 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	104	161	11956	12757	38	139	7077	7469	38	195	6624	7461
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6291	4290	0	0	3941	2387	0	0	4159	2710
Otros ^c	161	104	1620	2762	139	38	870	2002	195	38	599	1203
Total	265	265	19867	19809	177	177	11888	11858	233	233	11382	11374

^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