

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 16 de septiembre 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\$3210 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.83%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragruppo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 645,0 | 420,8 | 318,9 | 450,9 | 9,8 | 101,9 | 92,2 |
| 15-35 | 595,1 | 970,8 | 721,0 | 226,0 | 5,3 | 124,6 | 244,5 |
| 36-60 | 281,8 | 266,2 | 106,0 | 108,8 | 5,1 | 18,0 | 155,0 |
| 61-90 | 8,7 | 22,8 | 0,0 | 0,0 | 18,8 | 4,7 | 4,0 |
| 91-180 | 177,8 | 325,6 | 147,3 | 37,6 | 43,3 | 5,1 | 135,0 |
| >180 | 114,2 | 32,0 | 10,4 | 51,0 | 1,6 | 43,2 | 20,0 |
| Total | 1822,6 | 2038,2 | 1303,6 | 874,4 | 83,9 | 297,5 | 650,7 |

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| Rango | Intermediarios del Mercado Cambiario ^a | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|---|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 5.21% | 4.34% | 3.99% | 4.27% |
| 15-35 | 5.20% | 4.97% | 4.87% | 4.99% |
| 36-60 | 5.06% | 5.12% | 4.92% | 5.06% |
| 61-90 | 4.99% | 5.26% | 4.75% | 5.13% |
| 91-180 | 5.03% | 5.09% | 4.90% | 5.05% |
| >180 | 4.99% | 5.38% | 4.81% | 4.88% |
| Total | 5.12% | 4.92% | 4.45% | 4.83% |

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

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.

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards^a

| Sectores | 16 – 20 sept. | | | | 23 - 27 sept. | | | | 30 sept. - 04 oct. | | | |
|-------------------------------------|---------------|------------|--------------|--------------|---------------|------------|--------------|--------------|--------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero | 80 | 135 | 10067 | 10728 | 44 | 267 | 6397 | 6740 | 41 | 127 | 5505 | 6721 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 6407 | 5075 | 0 | 0 | 4193 | 2707 | 0 | 0 | 4080 | 1758 |
| Otros ^c | 135 | 80 | 1604 | 2260 | 267 | 44 | 824 | 1959 | 127 | 41 | 311 | 1416 |
| Total | 215 | 215 | 18078 | 18063 | 311 | 311 | 11414 | 11406 | 168 | 168 | 9896 | 9895 |

^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