

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de octubre de 2024
Fecha de Información: 01 de octubre 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\$5784 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.84%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 2090,9 | 1273,0 | 378,5 | 1170,6 | 5,4 | 31,3 | 889,0 |
| 15-35 | 983,8 | 1920,7 | 1195,7 | 248,1 | 28,9 | 0,0 | 735,7 |
| 36-60 | 128,0 | 196,4 | 128,3 | 24,4 | 8,1 | 43,6 | 60,0 |
| 61-90 | 468,8 | 500,6 | 39,4 | 0,0 | 1,1 | 8,8 | 460,0 |
| 91-180 | 31,2 | 14,9 | 0,3 | 0,0 | 14,6 | 31,2 | 0,0 |
| >180 | 185,4 | 160,4 | 134,5 | 155,2 | 0,9 | 5,1 | 25,0 |
| Total | 3888,1 | 4066,0 | 1876,8 | 1598,3 | 59,1 | 120,1 | 2169,7 |

^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 | 5.06% | 3.80% | 4.71% | 4.85% |
| 15-35 | 5.03% | 4.84% | 4.25% | 4.83% |
| 36-60 | 4.92% | 5.01% | 4.77% | 4.91% |
| 61-90 | 4.84% | 4.85% | 4.25% | 4.83% |
| 91-180 | – | 4.82% | 4.69% | 4.73% |
| >180 | 4.80% | 5.07% | 4.40% | 4.74% |
| Total | 4.99% | 4.78% | 4.60% | 4.84% |

^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 | 30 sept. - 04 oct. | | | | 07 - 11 oct. | | | | 14 - 18 oct. | | | |
|-------------------------------------|--------------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero | 70 | 100 | 8259 | 8504 | 105 | 107 | 10250 | 10686 | 71 | 107 | 6946 | 6815 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 4904 | 4068 | 0 | 0 | 6329 | 3995 | 0 | 0 | 3581 | 2597 |
| Otros ^c | 100 | 70 | 873 | 1460 | 107 | 105 | 398 | 1770 | 107 | 71 | 327 | 1427 |
| Total | 170 | 170 | 14036 | 14032 | 212 | 212 | 16977 | 16451 | 178 | 178 | 10854 | 10839 |

^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