

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de octubre de 2024
Fecha de Información: 02 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\$4310 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.01%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 | 997,1 | 906,7 | 434,4 | 667,9 | 171,2 | 28,2 | 301,0 |
| 15-35 | 1043,1 | 1095,4 | 557,5 | 473,0 | 35,9 | 68,0 | 502,0 |
| 36-60 | 118,3 | 8,9 | 0,0 | 0,0 | 8,5 | 117,9 | 0,4 |
| 61-90 | 154,2 | 199,7 | 189,8 | 75,0 | 9,9 | 79,2 | 0,0 |
| 91-180 | 200,6 | 182,5 | 161,1 | 84,9 | 10,5 | 104,7 | 11,0 |
| >180 | 154,7 | 138,0 | 60,8 | 50,3 | 2,2 | 29,4 | 75,0 |
| Total | 2668,0 | 2531,3 | 1403,6 | 1351,1 | 238,3 | 427,6 | 889,4 |

^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 | 5.18% | 5.20% | 4.93% | 5.10% |
| 15-35 | 5.18% | 4.93% | 4.90% | 5.02% |
| 36-60 | 4.98% | 5.11% | 4.98% | 4.99% |
| 61-90 | – | 4.98% | 4.83% | 4.86% |
| 91-180 | 4.83% | 4.93% | 4.81% | 4.84% |
| >180 | 4.85% | 4.89% | 4.75% | 4.83% |
| Total | 5.15% | 5.02% | 4.90% | 5.01% |

^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 | 59 | 94 | 7401 | 7325 | 107 | 118 | 10560 | 11187 | 72 | 107 | 7027 | 6850 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 4077 | 3627 | 0 | 0 | 6479 | 4101 | 0 | 0 | 3581 | 2648 |
| Otros ^c | 94 | 59 | 840 | 1365 | 118 | 107 | 555 | 1779 | 107 | 72 | 345 | 1440 |
| Total | 153 | 153 | 12318 | 12317 | 225 | 225 | 17594 | 17067 | 179 | 179 | 10953 | 10938 |

^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