

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de agosto de 2024
Fecha de Información: 30 de julio 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\$4265 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.53%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

| Rango | Sector Financiero ² | | Intragrupa y Off-shore ³ | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1199,7 | 378,8 | 112,2 | 881,9 | 4,3 | 55,5 | 262,3 |
| 15-35 | 1135,4 | 1401,6 | 598,2 | 413,1 | 153,8 | 72,7 | 649,6 |
| 36-60 | 72,1 | 417,5 | 360,3 | 1,7 | 22,2 | 35,4 | 35,0 |
| 61-90 | 51,9 | 4,6 | 0,0 | 0,0 | 4,2 | 51,6 | 0,4 |
| 91-180 | 296,3 | 208,3 | 95,1 | 100,0 | 8,2 | 91,3 | 105,0 |
| >180 | 148,1 | 63,2 | 0,0 | 35,0 | 2,9 | 52,8 | 60,3 |
| Total | 2903,5 | 2474,0 | 1165,8 | 1431,7 | 195,7 | 359,3 | 1112,5 |

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 | 5.73% | | 5.88% | 4.78% | 5.23% |
| 15-35 | 5.61% | | 5.73% | 5.60% | 5.65% |
| 36-60 | 5.69% | | 5.73% | 5.54% | 5.71% |
| 61-90 | 5.60% | | 5.90% | 5.56% | 5.59% |
| 91-180 | 5.57% | | 5.55% | 5.57% | 5.56% |
| >180 | 5.26% | | 6.10% | 5.11% | 5.19% |
| Total | 5.62% | | 5.73% | 5.25% | 5.53% |

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 | 29 jul. - 02 ago. | | | | 05 - 09 ago. | | | | 12 - 16 ago. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 225 | 237 | 7782 | 7688 | 414 | 103 | 6103 | 7633 | 61 | 145 | 7622 | 8478 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 4249 | 4137 | 0 | 0 | 4548 | 2790 | 0 | 0 | 5182 | 2487 |
| Otros ^c | 237 | 225 | 1196 | 1385 | 103 | 414 | 291 | 463 | 145 | 61 | 714 | 2496 |
| Total | 462 | 462 | 13227 | 13210 | 517 | 517 | 10942 | 10886 | 206 | 206 | 13518 | 13461 |

^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