

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de agosto de 2024
Fecha de Información: 02 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\$2900 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.35%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	763,6	539,6	225,5	432,0	14,6	32,1	299,5
15-35	807,0	1203,6	649,4	234,2	18,4	37,0	535,8
36-60	107,1	139,6	40,0	2,2	8,6	13,9	91,0
61-90	42,4	63,3	50,0	19,1	3,3	13,2	10,0
91-180	8,7	81,7	76,1	0,0	5,6	8,7	0,0
>180	31,5	48,8	48,6	1,0	0,2	30,5	0,0
Total	1760,2	2076,6	1089,6	688,5	50,6	135,4	936,3

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ¹		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.43%		5.04%	5.19%	5.27%
15-35	5.45%		5.39%	5.19%	5.39%
36-60	5.37%		5.41%	4.76%	5.32%
61-90	5.52%		5.58%	5.27%	5.52%
91-180	—		5.58%	5.01%	5.25%
>180	—		5.76%	4.97%	4.97%
Total	5.44%		5.36%	5.16%	5.35%

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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) $^{\wedge}$ (365/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	87	37	1384	1490	517	113	7230	8213	72	146	8411	9158
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	640	512	0	0	4829	3582	0	0	5402	2799
Otros ^c	37	87	392	413	113	517	340	549	146	72	746	2544
Total	124	124	2416	2415	630	630	12399	12344	218	218	14559	14501

^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