

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de agosto de 2024
Fecha de Información: 06 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\$5534 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.78%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	1933,3	1653,7	274,3	775,5	239,8	18,1	1139,6
15-35	809,8	1129,2	706,0	239,0	32,0	179,6	391,2
36-60	256,1	24,0	1,2	0,0	11,8	245,1	11,0
61-90	531,9	819,8	304,8	13,8	9,9	13,1	505,1
91-180	135,7	74,2	52,3	0,0	1,9	115,7	20,0
>180	126,3	167,4	106,9	55,7	0,5	10,6	60,0
Total	3793,1	3868,3	1445,5	1084,0	295,9	582,2	2126,9

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	5.84%		5.79%	5.52%	5.75%
15-35	5.92%		5.95%	5.86%	5.92%
36-60	5.90%		6.05%	5.88%	5.89%
61-90	5.67%		5.84%	5.42%	5.67%
91-180	5.67%		5.68%	5.53%	5.58%
>180	5.35%		5.47%	5.08%	5.38%
Total	5.80%		5.86%	5.67%	5.78%

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) ^ (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	05 - 09 ago.				12 - 16 ago.				19 - 23 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	426	108	6032	6571	84	155	10239	11134	31	137	6515	6755
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3951	3155	0	0	5598	3400	0	0	3675	2118
Otros ^c	108	426	305	512	155	84	1339	2585	137	31	647	1935
Total	534	534	10288	10238	239	239	17176	17119	168	168	10837	10808

^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