

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2024
Fecha de Información: 08 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\$4311 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.63%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1559,8	1147,4	390,2	815,4	33,0	20,3	724,1
15-35	826,9	1086,9	718,5	280,0	36,4	214,9	332,0
36-60	40,7	23,0	0,0	30,0	23,0	10,7	0,0
61-90	205,4	208,2	117,5	123,6	19,9	11,1	70,8
91-180	47,7	119,9	100,8	30,0	19,1	17,7	0,0
>180	89,4	107,7	80,7	43,6	2,0	20,8	25,0
Total	2770,1	2693,1	1407,7	1322,6	133,4	295,6	1151,9

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	5.85%	5.36%	4.50%	5.41%
15-35	5.84%	5.97%	5.75%	5.87%
36-60	—	5.98%	5.81%	5.87%
61-90	5.73%	5.77%	5.45%	5.73%
91-180	—	5.49%	5.48%	5.49%
>180	5.27%	5.87%	4.98%	5.17%
Total	5.83%	5.74%	5.21%	5.63%

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{365}{\text{Plazo}}}) - 1$. 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	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	324	78	4687	5100	87	157	11281	12011	33	137	6706	6905
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3039	2435	0	0	5925	3892	0	0	3759	2235
Otros ^c	78	324	251	392	157	87	1345	2591	137	33	672	1968
Total	402	402	7977	7927	244	244	18551	18494	170	170	11137	11108

^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