

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2024
Fecha de Información: 20 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\$3978 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.22%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero ^a		Intragruppo y Off-shore ^b		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
0-14	1152,8	927,0	319,7	849,5	333,9	29,9	273,4
15-35	641,2	876,1	746,5	488,5	13,1	36,2	116,5
36-60	319,9	95,0	6,0	9,3	19,1	240,6	70,0
61-90	54,2	31,2	0,4	0,0	29,9	53,4	0,8
91-180	102,1	69,6	32,1	45,9	22,5	41,2	15,0
>180	45,9	159,1	120,7	25,9	18,4	0,0	20,0
Total	2316,1	2158,0	1225,4	1419,1	436,9	401,3	495,7

Nota: Cifras en millones de dólares.

^a Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes.

^b 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	
1-14	5.49%		5.50%	4.31%	4.95%
15-35	5.45%		5.40%	5.42%	5.41%
36-60	5.52%		5.60%	5.61%	5.59%
61-90	5.60%		6.09%	5.31%	5.59%
91-180	5.33%		5.34%	5.16%	5.26%
>180	5.14%		5.16%	-	5.16%
Total	5.47%		5.44%	4.91%	5.22%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	19 – 23 ago.				26 - 30 ago.				02 - 06 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	43	166	9220	9154	55	202	7720	8758	30	81	6251	7229
Intragrupo y off-shore ^a	0	0	4423	3996	0	0	4470	3105	0	0	3920	2199
Otros ^b	166	43	1675	2139	202	55	957	1276	81	30	444	1158
Total	209	209	15318	15289	257	257	13147	13139	111	111	10615	10586

Nota: Cifras en millones de dólares.

^a Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes