

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2024
Fecha de Información: 21 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\$3072 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.18%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	733,5	522,9	239,6	456,6	18,5	12,2	264,7
15-35	565,8	726,4	598,7	452,6	40,0	25,5	87,7
36-60	18,1	15,1	0,0	0,0	15,1	18,1	0,0
61-90	95,6	67,8	32,0	36,4	20,8	44,2	15,0
91-180	37,9	70,9	32,0	25,4	34,6	8,1	4,3
>180	309,6	316,3	273,6	257,8	6,7	15,8	36,0
Total	1760,6	1719,4	1175,9	1228,9	135,8	124,0	407,7

^a Cifras en millones de dólares

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

^c 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	
3-14	5.46%	5.40%	4.62%	5.06%
15-35	5.20%	5.23%	5.29%	5.25%
36-60	–	6.02%	5.18%	5.57%
61-90	5.34%	5.33%	5.40%	5.36%
91-180	5.09%	5.34%	5.12%	5.28%
>180	5.06%	5.16%	5.04%	5.07%
Total	5.36%	5.28%	4.99%	5.18%

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

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards^a

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	33	143	7199	7006	57	206	8171	9127	31	81	6270	7256
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3342	3338	0	0	4575	3272	0	0	3935	2212
Otros ^c	143	33	1162	1329	206	57	971	1311	81	31	456	1163
Total	176	176	11703	11673	263	263	13717	13710	112	112	10661	10631

^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