

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2024
Fecha de Información: 23 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\$2977 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.73%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	861,5	542,0	165,5	624,3	172,5	33,2	204
15-35	599,0	943,6	668,9	352,5	47,7	19,5	227
36-60	23,0	52,5	20,0	0,0	12,5	3,0	20
61-90	23,4	86,6	74,2	0,0	12,4	23,4	0
91-180	159,2	53,6	0,3	36,2	53,2	123,1	0
>180	38,9	74,3	42,5	8,5	1,8	0,5	30
Total	1705,1	1752,6	971,4	1021,4	300,2	202,7	481

^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	5.20%	2.62%	4.40%	4.08%
15-35	5.23%	5.17%	4.85%	5.10%
36-60	5.29%	5.33%	5.02%	5.30%
61-90	–	6.25%	5.19%	5.56%
91-180	–	6.13%	4.96%	5.31%
>180	5.18%	5.20%	5.29%	5.19%
Total	5.22%	4.57%	4.64%	4.73%

^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^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	14	80	685	954	66	209	9362	9909	36	82	6742	7455
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	388	440	0	0	4859	4089	0	0	3935	2527
Otros ^c	80	14	414	83	209	66	1118	1333	82	36	526	1193
Total	94	94	1487	1477	275	275	15339	15331	118	118	11203	11175

^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