

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2024
Fecha de Información: 28 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\$4240 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.79%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	886,6	411,8	297,2	741,8	4,1	34,4	110,5
15-35	946,5	1007,7	727,2	670,9	37,5	0,0	275,6
36-60	31,8	115,9	101,0	0,0	4,9	21,8	10,0
61-90	320,5	629,2	498,4	180,5	11,7	20,8	119,1
91-180	17,5	17,6	0,3	0,0	17,3	17,5	0,0
>180	117,7	327,9	252,6	30,9	0,3	11,9	75,0
Total	2320,7	2510,0	1876,6	1624,1	75,7	106,3	590,2

^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	5.07%	4.34%	4.99%	4.86%
15-35	5.06%	4.89%	4.18%	4.67%
36-60	5.07%	5.22%	5.01%	5.05%
61-90	5.10%	5.15%	4.54%	4.96%
91-180	–	5.30%	5.03%	5.16%
>180	5.06%	4.65%	4.61%	4.78%
Total	5.07%	4.84%	4.59%	4.79%

^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	26 – 30 ago.				02 - 06 sept.				09 - 13 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	41	157	7265	7639	67	95	7624	8048	63	120	8131	8838
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3896	3602	0	0	4104	3176	0	0	5177	2895
Otros ^c	157	41	727	646	95	67	741	1216	120	63	367	1901
Total	198	198	11888	11887	162	162	12469	12440	183	183	13675	13634

^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