

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de septiembre de 2024

Fecha de Información: 30 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\$3040 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.07%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	425,5	350,2	292,4	325,4	12,3	54,6	45,5
15-35	545,8	1023,6	684,4	169,9	57,2	93,9	282,0
36-60	104,1	65,9	0,0	1,0	32,9	70,1	33,0
61-90	144,8	175,3	104,1	24,6	16,2	65,2	55,0
91-180	205,6	175,1	122,0	139,0	23,1	36,6	30,0
>180	115,9	199,0	153,8	36,8	0,2	34,1	45,0
Total	1541,7	1989,0	1356,7	696,7	141,9	354,5	490,5

^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	5.08%	5.17%	4.57%	4.88%
15-35	5.19%	5.15%	5.07%	5.15%
36-60	5.10%	5.19%	5.00%	5.07%
61-90	5.07%	5.17%	5.00%	5.06%
91-180	5.13%	5.35%	4.88%	5.19%
>180	5.02%	4.93%	4.85%	4.93%
Total	5.14%	5.15%	4.90%	5.07%

^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	15	43	834	875	82	97	8056	8406	95	119	8431	9121
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	422	353	0	0	4426	3562	0	0	5370	3043
Otros ^c	43	15	41	69	97	82	743	1227	119	95	397	1992
Total	58	58	1297	1297	179	179	13225	13195	214	214	14198	14156

^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