

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 03 de septiembre 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\$3975 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.28%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	995,3	765,4	294,4	541,5	45,0	27,8	426,0
15-35	983,4	1254,2	692,0	265,0	15,1	171,4	547,0
36-60	115,2	150,4	80,9	10,0	9,5	45,2	60,0
61-90	91,3	30,1	20,5	17,0	8,7	73,3	1,0
91-180	148,2	147,0	75,2	46,1	19,3	49,6	52,5
>180	236,8	228,9	141,6	123,0	2,3	28,8	85,0
Total	2570,2	2575,9	1304,6	1002,6	99,8	396,1	1171,5

^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	5.35%	5.45%	5.34%	5.36%
15-35	5.35%	5.31%	5.24%	5.31%
36-60	5.28%	5.31%	5.10%	5.23%
61-90	5.08%	6.35%	5.03%	5.17%
91-180	5.16%	5.35%	4.79%	5.04%
>180	5.05%	5.05%	4.97%	5.03%
Total	5.32%	5.31%	5.20%	5.28%

^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	02 – 06 sept.				09 - 13 sept.				16 - 20 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	87	105	8794	8857	98	129	8768	9451	39	117	7277	7350
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4653	4058	0	0	5465	3145	0	0	4534	2996
Otros ^c	105	87	724	1227	129	98	432	2028	117	39	576	2029
Total	192	192	14171	14142	227	227	14665	14624	156	156	12387	12375

^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