

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de agosto de 2024
Fecha de Información: 15 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\$3402 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.20%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero ^a		Intragruppo y Off-shore ^b		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	325,1	380,2	262,5	222,3	40,0	25,1	77,7
15-35	804,6	1238,9	852,0	452,1	107,8	73,5	279,0
36-60	213,4	229,1	42,4	80,8	56,7	2,6	130,0
61-90	190,5	72,7	5,4	30,7	26,5	119,1	40,8
91-180	164,6	107,9	59,3	129,6	28,6	15,1	20,0
>180	173,7	93,9	42,5	127,2	6,4	1,6	45,0
Total	1872,1	2122,6	1264,1	1042,7	266,0	236,8	592,6

Nota: Cifras en millones de dólares.

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

^b 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	5.76%	5.75%	5.64%	5.72%
15-35	5.63%	5.12%	4.28%	4.95%
36-60	5.58%	5.68%	5.53%	5.62%
61-90	5.60%	5.56%	5.48%	5.52%
91-180	5.52%	5.49%	4.84%	5.24%
>180	5.29%	5.23%	5.13%	5.20%
Total	5.60%	5.30%	4.76%	5.20%

^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

Sectores	12 – 16 ago.				19 - 23 ago.				26 - 30 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	52	84	5598	6129	44	159	8134	8603	43	204	7236	8123
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3189	2586	0	0	4176	3057	0	0	4359	2903
Otros ^c	84	52	689	742	158	44	1500	2120	204	43	683	1245
Total	136	136	9476	9457	202	203	13810	13780	247	247	12278	12271

^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