

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2024
Fecha de Información: 26 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\$3638 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.76%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	1013,3	610,9	285,0	731,5	160,9	116,9	165
15-35	637,1	1180,2	840,1	405,0	137,1	29,1	203
36-60	47,4	13,4	2,5	0,0	11,0	47,4	0
61-90	8,7	7,1	0,0	0,0	7,1	8,7	0
91-180	248,0	171,0	135,4	1,7	15,5	226,3	20
>180	57,5	65,8	26,7	16,1	4,1	6,4	35
Total	2012,1	2048,4	1289,7	1154,3	335,7	434,8	423

^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%		4.48%	4.42%	4.55%
15-35	5.20%		4.89%	4.32%	4.78%
36-60	—		5.37%	5.13%	5.17%
61-90	—		5.61%	10.21%	8.15%
91-180	5.15%		5.22%	5.05%	5.11%
>180	5.10%		5.15%	4.75%	5.08%
Total	5.19%		4.82%	4.57%	4.76%

^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.

¹ A 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.

² El 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	51	205	10093	10301	55	91	6914	7641	50	113	7594	8662
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5139	4606	0	0	3945	2675	0	0	5164	2519
Otros ^c	205	51	1118	1436	91	55	683	1197	113	50	327	1868
Total	256	256	16350	16343	146	146	11542	11513	163	163	13085	13049

^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