

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 29 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\$3562 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.37%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	623,2	575,5	396,9	433,7	28,6	39,4	150,0
15-35	846,2	1017,1	630,2	464,8	111,9	106,4	275,0
36-60	96,4	204,3	129,0	0,0	2,8	23,9	72,5
61-90	35,8	44,8	28,0	0,0	15,7	34,8	1,0
91-180	223,6	129,6	87,5	138,7	17,0	60,0	25,0
>180	156,8	146,2	116,6	114,0	15,2	28,4	14,4
Total	1982,0	2117,4	1388,3	1151,1	191,2	293,0	537,9

^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%		4.66%	4.45%	4.64%
15-35	5.05%		7.91%	4.33%	6.13%
36-60	5.05%		3.89%	4.44%	4.31%
61-90	5.03%		5.26%	4.89%	5.00%
91-180	5.11%		5.14%	4.94%	5.05%
>180	5.05%		5.08%	4.81%	4.95%
Total	5.06%		6.31%	4.46%	5.37%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	34	105	4394	4465	75	93	7817	8211	76	119	8269	8979
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2137	2110	0	0	4266	3363	0	0	5243	2931
Otros ^c	105	34	516	471	93	75	742	1222	119	76	393	1953
Total	139	139	7047	7046	168	168	12825	12796	195	195	13905	13863

^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