

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 02 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\$411 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.00%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	73,8	52,6	23,0	47,4	4,4	1,2	25,2
15-35	71,0	51,0	36,5	48,5	1,5	9,5	13,0
36-60	1,1	3,8	3,1	0,0	0,7	1,1	0,0
61-90	3,3	1,3	0,0	0,0	1,3	3,3	0,0
91-180	4,6	4,5	3,7	3,3	0,9	1,3	0,0
>180	80,2	102,3	102,3	79,4	0,1	0,8	0,0
Total	233,9	215,6	168,6	178,6	8,9	17,1	38,2

^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	4.41%	5.35%	4.74%	4.58%
15-35	5.09%	5.30%	4.94%	5.08%
36-60	–	5.41%	4.97%	5.15%
61-90	–	11.23%	4.87%	6.73%
91-180	–	4.47%	4.45%	4.46%
>180	–	5.37%	4.69%	4.73%
Total	4.64%	5.49%	4.91%	5.00%

^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	85	105	8140	8457	95	119	8472	9137	37	116	7221	7263
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4449	3619	0	0	5370	3068	0	0	4464	2966
Otros ^c	105	85	742	1225	119	95	396	1992	116	37	569	2013
Total	190	190	13331	13301	214	214	14238	14197	153	153	12254	12242

^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