

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2024
Fecha de Información: 13 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\$4448 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.41%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

Rango	Sector Financiero ²		Intragrupo y Off-shore ³		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	1001,7	1156,1	281,0	568,1	457,5	16,0	417,6
15-35	969,1	1304,6	522,1	234,0	83,0	35,6	699,5
36-60	283,6	103,0	51,2	75,5	51,9	208,1	0,0
61-90	4,5	13,4	0,0	0,0	12,2	3,4	1,1
91-180	332,0	134,7	80,0	0,2	27,2	304,3	27,5
>180	152,8	168,3	128,9	67,9	9,4	54,9	30,0
Total	2743,7	2880,1	1063,1	945,7	641,2	622,3	1175,8

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ¹		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.73%		4.35%	5.83%	5.15%
15-35	5.70%		5.69%	5.36%	5.65%
36-60	—		5.27%	5.61%	5.52%
61-90	5.42%		5.66%	5.36%	5.58%
91-180	5.45%		5.24%	5.37%	5.37%
>180	5.15%		5.31%	5.24%	5.23%
Total	5.69%		5.02%	5.55%	5.41%

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.

³Cifras en millones de dólares

²Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

³Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

¹Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

"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	89	127	10691	11222	42	146	7455	7897	40	198	6915	7728
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5586	4059	0	0	4026	2618	0	0	4177	2743
Otros ^c	127	89	1126	2070	146	42	1069	2005	198	40	623	1237
Total	216	216	17403	17351	188	188	12550	12520	238	238	11715	11708

^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