

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 06 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\$3550 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.10%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	597,8	728,9	335,3	240,9	139,1	102,4	254,5
15-35	862,9	863,1	305,8	285,0	19,9	40,4	537,4
36-60	57,1	42,2	12,3	0,0	17,9	45,1	12,0
61-90	69,0	129,2	110,7	0,0	18,5	69,0	0,0
91-180	147,4	53,3	30,2	135,8	18,2	6,6	5,0
>180	749,2	756,3	58,0	48,3	0,3	2,9	698,0
Total	2483,4	2573,0	852,2	710,1	213,8	266,5	1506,9

^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	5.23%	5.23%	4.32%	4.99%
15-35	5.19%	5.26%	5.19%	5.20%
36-60	5.13%	5.41%	5.10%	5.21%
61-90	–	5.21%	5.20%	5.20%
91-180	5.10%	5.28%	4.82%	5.15%
>180	5.06%	5.08%	4.84%	5.06%
Total	5.14%	5.25%	4.86%	5.10%

^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	26	22	401	459	129	131	9821	10535	45	118	7688	8263
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	291	202	0	0	6000	3915	0	0	5192	3076
Otros ^c	22	26	42	72	131	129	737	2063	118	45	608	2134
Total	48	48	734	733	260	260	16558	16513	163	163	13488	13473

^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