

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 11 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\$4821 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.68%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	738,9	948,9	402,6	628,1	475,3	39,8	71,0
15-35	967,9	806,3	581,0	749,0	55,8	49,4	169,5
36-60	126,3	379,4	355,2	70,0	3,6	35,7	20,5
61-90	373,0	23,7	0,5	0,0	23,2	373,0	0,0
91-180	272,2	475,5	335,7	47,8	31,4	115,9	108,5
>180	40,8	43,1	27,0	9,4	11,0	26,4	5,0
Total	2518,9	2676,9	1702,1	1504,2	600,3	640,2	374,6

^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	5.24%	4.41%	4.43%	4.46%
15-35	5.25%	5.10%	4.30%	4.75%
36-60	5.05%	4.31%	4.99%	4.44%
61-90	–	5.16%	5.15%	5.15%
91-180	5.05%	4.76%	4.94%	4.88%
>180	4.96%	5.13%	4.74%	4.87%
Total	5.17%	4.66%	4.59%	4.68%

^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	09 – 13 sept.				16 - 20 sept.				23 - 27 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	119	91	7362	7825	66	126	8660	9528	31	265	5888	6175
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4806	3514	0	0	5879	3853	0	0	3806	2503
Otros ^c	91	119	592	1403	126	66	1082	2226	265	31	801	1816
Total	210	210	12760	12742	192	192	15621	15607	296	296	10495	10494

^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