

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 13 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\$3282 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.99%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	857,4	924,3	368,9	615,1	363,9	50,8	191,5
15-35	554,8	440,2	161,0	255,0	37,6	58,2	241,6
36-60	123,1	47,5	15,0	0,0	17,1	107,8	15,3
61-90	22,0	101,0	44,4	0,0	46,6	12,0	10,0
91-180	303,2	249,5	180,2	0,0	19,2	253,2	50,0
>180	73,2	118,9	91,8	47,7	2,2	0,5	25,0
Total	1933,8	1881,4	861,3	917,8	486,6	482,5	533,4

^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	5.31%	4.44%	5.23%	4.87%
15-35	5.29%	5.41%	4.84%	5.15%
36-60	5.19%	5.31%	5.24%	5.25%
61-90	5.07%	5.20%	4.94%	5.14%
91-180	5.06%	5.12%	4.94%	5.02%
>180	4.90%	4.96%	4.82%	4.94%
Total	5.25%	4.78%	5.08%	4.99%

^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	19	38	562	530	77	127	9716	10542	36	267	6207	6564
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	362	379	0	0	6293	4811	0	0	4034	2632
Otros ^c	38	19	51	65	127	77	1602	2243	267	36	820	1858
Total	57	57	975	974	204	204	17611	17596	303	303	11061	11054

^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