

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 16 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\$3210 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.83%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	645,0	420,8	318,9	450,9	9,8	101,9	92,2
15-35	595,1	970,8	721,0	226,0	5,3	124,6	244,5
36-60	281,8	266,2	106,0	108,8	5,1	18,0	155,0
61-90	8,7	22,8	0,0	0,0	18,8	4,7	4,0
91-180	177,8	325,6	147,3	37,6	43,3	5,1	135,0
>180	114,2	32,0	10,4	51,0	1,6	43,2	20,0
Total	1822,6	2038,2	1303,6	874,4	83,9	297,5	650,7

^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	5.21%	4.34%	3.99%	4.27%
15-35	5.20%	4.97%	4.87%	4.99%
36-60	5.06%	5.12%	4.92%	5.06%
61-90	4.99%	5.26%	4.75%	5.13%
91-180	5.03%	5.09%	4.90%	5.05%
>180	4.99%	5.38%	4.81%	4.88%
Total	5.12%	4.92%	4.45%	4.83%

^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	16 – 20 sept.				23 - 27 sept.				30 sept. - 04 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	80	135	10067	10728	44	267	6397	6740	41	127	5505	6721
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6407	5075	0	0	4193	2707	0	0	4080	1758
Otros ^c	135	80	1604	2260	267	44	824	1959	127	41	311	1416
Total	215	215	18078	18063	311	311	11414	11406	168	168	9896	9895

^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