

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 17 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\$3771 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.11%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	268,5	470,4	244,7	215,3	197,8	25,2	28,0
15-35	1151,3	1035,9	741,2	682,4	21,6	195,9	273,0
36-60	98,6	80,9	28,5	23,5	27,4	50,0	25,0
61-90	189,7	20,0	0,0	0,0	20,0	189,7	0,0
91-180	348,6	364,8	135,0	74,0	19,8	64,6	210,0
>180	144,7	188,8	132,6	77,0	1,6	13,0	54,7
Total	2201,4	2160,7	1281,9	1072,3	288,1	538,4	590,7

^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	5.22%	5.19%	6.88%	5.55%
15-35	5.19%	4.86%	5.10%	5.04%
36-60	5.01%	5.32%	4.94%	5.08%
61-90	–	5.08%	5.05%	5.05%
91-180	5.05%	5.04%	4.89%	5.02%
>180	4.92%	4.98%	4.92%	4.95%
Total	5.11%	5.01%	5.19%	5.11%

^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	56	120	5874	6383	47	266	6629	7100	42	127	5589	6737
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3688	2852	0	0	4324	2877	0	0	4080	1803
Otros ^c	120	56	1067	1378	266	47	1018	1986	127	42	316	1442
Total	176	176	10629	10613	313	313	11971	11963	169	169	9985	9982

^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