

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 19 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\$3386 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.70%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	1014,8	840,5	553,8	734,4	30,1	23,8	256,6
15-35	650,9	674,3	389,8	330,6	37,1	72,9	247,4
36-60	6,5	8,3	0,6	0,0	7,8	6,5	0,0
61-90	82,4	145,2	94,9	50,1	25,2	7,4	25,0
91-180	93,7	58,4	2,5	16,6	20,8	42,2	35,0
>180	184,6	235,0	181,2	131,3	8,8	8,3	45,0
Total	2033,0	1961,6	1222,8	1262,9	129,8	161,1	609,0

^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	5.03%	3.83%	3.79%	4.18%
15-35	5.08%	5.24%	4.99%	5.12%
36-60	–	5.36%	4.76%	5.08%
61-90	5.00%	5.02%	4.96%	5.00%
91-180	4.95%	4.95%	4.80%	4.89%
>180	4.88%	4.87%	4.79%	4.84%
Total	5.04%	4.70%	4.42%	4.70%

^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	33	71	3759	3580	52	274	7749	8136	45	130	6111	7080
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2464	2378	0	0	4761	3604	0	0	4283	2176
Otros ^c	71	33	168	421	274	52	1230	1993	130	45	339	1474
Total	104	104	6391	6379	326	326	13740	13733	175	175	10733	10730

^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