

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 23 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\$4669 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.12%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	1050,1	880,1	391,8	514,0	91,5	139,3	396,7
15-35	1020,0	578,2	247,1	671,1	30,3	48,2	300,8
36-60	305,6	272,7	147,1	200,0	115,6	95,6	10,0
61-90	1,6	7,5	0,0	0,0	7,5	1,6	0,0
91-180	314,0	800,4	699,3	221,3	11,0	2,6	90,0
>180	40,2	211,3	192,5	23,6	3,8	1,6	15,0
Total	2731,5	2750,1	1677,9	1630,0	259,7	289,1	812,5

^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	5.29%		5.33%	4.62%	5.08%
15-35	5.24%		5.23%	5.13%	5.21%
36-60	5.11%		5.08%	5.19%	5.14%
61-90	-		5.33%	4.96%	5.27%
91-180	4.97%		5.04%	4.74%	5.01%
>180	4.84%		5.50%	4.76%	4.96%
Total	5.23%		5.21%	4.91%	5.12%

^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	23 – 27 sept.				30 sept. - 04 oct.				07 - 11 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	61	268	9236	9298	59	133	6274	7304	58	103	8473	9020
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	5409	4515	0	0	4308	2224	0	0	5857	3390
Otros ^c	268	61	1391	2216	133	59	451	1503	103	58	316	1722
Total	329	329	16036	16029	192	192	11033	11031	161	161	14646	14132

^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