

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 24 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\$4116 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.05%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	809,8	752,2	379,0	551,9	142,4	27,0	230,9
15-35	829,8	920,3	565,2	501,1	40,1	13,8	314,9
36-60	211,6	156,5	90,6	0,0	25,9	171,6	40,0
61-90	351,9	173,5	143,4	347,6	29,3	3,5	0,8
91-180	103,8	75,5	33,6	39,1	30,7	53,6	11,1
>180	184,1	159,5	142,4	160,0	2,8	9,9	14,3
Total	2490,9	2237,4	1354,3	1599,6	271,2	279,4	611,9

^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	5.09%	5.63%	5.19%	5.29%
15-35	5.07%	4.56%	5.02%	4.92%
36-60	5.01%	5.03%	5.05%	5.04%
61-90	4.96%	5.29%	4.94%	5.28%
91-180	4.90%	4.99%	4.78%	4.89%
>180	4.81%	5.12%	4.69%	4.75%
Total	5.06%	5.06%	5.02%	5.05%

^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	56	209	8155	8180	67	135	6505	7519	59	104	8631	9538
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4715	4006	0	0	4330	2360	0	0	6216	3392
Otros ^c	209	56	1112	1790	135	67	564	1516	104	59	325	1727
Total	265	265	13982	13976	202	202	11399	11395	163	163	15172	14657

^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