

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 20 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\$4353 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.73%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	670,5	506,8	286,4	612,1	190,9	28,9	29,5
15-35	1336,7	1464,2	677,0	552,0	33,2	30,7	754,0
36-60	3,7	14,6	0,0	0,0	14,6	3,7	0,0
61-90	458,2	230,0	70,7	292,6	49,2	55,6	110,0
91-180	55,5	268,3	243,4	0,0	19,2	49,8	5,7
>180	14,5	236,6	228,3	7,6	1,3	0,0	6,9
Total	2539,0	2720,4	1505,9	1464,2	308,4	168,7	906,1

^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	5.10%	5.21%	3.60%	4.45%
15-35	5.07%	4.87%	4.26%	4.77%
36-60	—	5.20%	2.51%	4.66%
61-90	4.96%	4.99%	4.94%	4.97%
91-180	4.89%	4.67%	4.85%	4.71%
>180	4.75%	5.00%	—	4.79%
Total	5.06%	4.91%	4.17%	4.73%

^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	13	28	906	916	58	278	8374	8658	50	132	6155	7209
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	623	527	0	0	5066	4065	0	0	4298	2196
Otros ^c	28	13	44	121	278	58	1296	2005	132	50	443	1489
Total	41	41	1573	1564	336	336	14736	14728	182	182	10896	10894

^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