

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 25 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\$4371 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.71%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	1112,9	778,1	587,1	1012,7	121,5	30,8	69,5
15-35	813,3	1060,8	780,2	468,5	14,1	78,3	266,5
36-60	100,6	44,9	20,0	0,0	24,9	100,6	0,0
61-90	229,3	436,4	360,0	161,5	16,4	7,8	60,0
91-180	14,9	11,3	0,0	0,0	11,3	14,9	0,0
>180	93,1	111,3	64,0	33,9	7,4	19,1	40,0
Total	2364,0	2442,9	1811,3	1676,6	195,5	251,4	436,0

^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		
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	5.08%	5.13%	4.46%	4.69%
15-35	5.07%	4.86%	4.30%	4.72%
36-60	—	5.34%	5.03%	5.13%
61-90	4.97%	4.30%	4.91%	4.46%
91-180	—	5.52%	4.87%	5.15%
>180	4.84%	4.87%	4.86%	4.86%
Total	5.04%	4.84%	4.46%	4.71%

^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.

¹ A 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.

² El 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	41	208	6584	6421	83	136	6774	7837	64	106	8809	9639
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3908	3898	0	0	4481	2576	0	0	6247	3476
Otros ^c	208	41	740	911	136	83	680	1520	106	64	326	1751
Total	249	249	11232	11230	219	219	11935	11933	170	170	15382	14866

^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