

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2024
Fecha de Información: 26 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\$3228 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.97%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	920,6	660,4	494,9	761,4	22,5	16,2	143,0
15-35	523,1	736,5	360,0	131,8	35,5	50,4	341,0
36-60	209,9	169,6	0,0	25,0	8,9	24,1	160,8
61-90	45,3	208,4	201,5	42,4	6,9	3,0	0,0
91-180	100,6	86,5	49,7	70,7	36,8	29,9	0,0
>180	131,1	130,7	77,3	80,2	3,5	0,9	50,0
Total	1930,6	1992,2	1183,4	1111,4	114,1	124,5	694,8

^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	5.11%		4.46%	4.73%	4.80%
15-35	5.08%		5.11%	4.99%	5.07%
36-60	5.01%		5.52%	4.89%	5.02%
61-90	—		4.42%	4.79%	4.49%
91-180	—		4.89%	4.91%	4.90%
>180	4.88%		5.14%	4.84%	4.90%
Total	5.05%		4.97%	4.85%	4.97%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	35	159	4784	4956	87	142	7529	8215	65	105	8980	9684
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2811	2753	0	0	4607	3087	0	0	6247	3600
Otros ^c	159	35	668	554	142	87	687	1518	105	65	332	1753
Total	194	194	8263	8263	229	229	12823	12820	170	170	15559	15037

^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