

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de octubre de 2024

Fecha de Información: 30 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\$4143 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.91%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	622,4	540,4	404,7	550,1	72,7	9,4	63,0
15-35	953,4	1234,4	713,6	545,3	174,3	61,6	346,5
36-60	243,5	53,4	41,8	175,0	11,6	68,5	0,0
61-90	47,7	264,6	241,2	24,1	8,4	8,6	15,0
91-180	24,9	39,9	11,5	3,9	28,5	21,0	0,0
>180	497,4	476,9	28,2	52,0	16,7	13,4	432,0
Total	2389,4	2609,6	1441,0	1350,4	312,1	182,5	856,5

^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		
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	5.02%	5.09%	4.36%	4.66%
15-35	4.96%	5.01%	4.92%	4.98%
36-60	—	5.08%	4.96%	4.97%
61-90	4.83%	5.07%	4.84%	4.94%
91-180	—	4.98%	4.77%	4.88%
>180	4.82%	4.90%	4.80%	4.82%
Total	4.89%	5.02%	4.79%	4.91%

^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	30 sept. - 04 oct.				07 - 11 oct.				14 - 18 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	92	109	8674	9334	97	108	9343	9954	69	107	6824	6706
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5367	4152	0	0	6277	3787	0	0	3538	2533
Otros ^c	109	92	964	1515	108	97	400	1757	107	69	316	1425
Total	201	201	15005	15001	205	205	16020	15498	176	176	10678	10664

^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