

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de octubre de 2024
Fecha de Información: 03 de octubre 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\$3740 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.88%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	856,4	753,3	583,0	721,6	54,3	18,8	116,0
15-35	824,2	1136,7	748,6	438,7	14,7	12,0	373,5
36-60	117,7	60,6	0,0	0,0	10,6	67,7	50,0
61-90	25,7	107,2	59,6	15,5	37,6	0,2	10,0
91-180	56,8	101,8	66,9	1,7	19,9	40,1	15,0
>180	144,0	155,7	119,8	109,0	0,9	0,0	35,0
Total	2024,8	2315,2	1577,8	1286,5	137,9	138,8	599,5

^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	5.25%		4.63%	4.65%	4.72%
15-35	5.25%		5.09%	4.36%	4.97%
36-60	5.15%		5.09%	5.07%	5.10%
61-90	4.99%		5.02%	4.86%	5.01%
91-180	4.91%		4.72%	4.74%	4.77%
>180	4.84%		4.40%	4.88%	4.69%
Total	5.20%		4.92%	4.59%	4.88%

^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	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	40	61	4784	4844	112	120	11179	11586	74	102	7043	6979
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2899	2753	0	0	6773	4640	0	0	3694	2648
Otros ^c	61	40	141	226	120	112	590	1789	102	74	360	1456
Total	101	101	7824	7823	232	232	18542	18015	176	176	11097	11083

^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