

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de octubre de 2024
Fecha de Información: 04 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\$3445 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.68%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	750,6	628,8	499,2	600,6	24,1	44,5	105,5
15-35	722,4	625,6	391,5	493,8	64,1	58,6	170,0
36-60	5,7	38,5	0,0	0,0	38,5	5,7	0,0
61-90	15,3	99,6	89,8	13,0	9,8	2,3	0,0
91-180	130,9	78,6	24,7	104,6	28,8	1,4	25,0
>180	351,2	382,8	297,4	265,5	0,8	1,1	84,6
Total	1976,1	1853,9	1302,6	1477,4	166,2	113,6	385,1

^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		
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	4.42%	5.40%	3.62%	4.32%
15-35	5.18%	4.82%	4.65%	4.80%
36-60	—	5.19%	4.95%	5.16%
61-90	—	4.99%	4.88%	4.99%
91-180	4.92%	5.11%	4.84%	4.99%
>180	4.80%	4.77%	4.82%	4.80%
Total	4.88%	5.00%	4.30%	4.68%

^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	16	26	1016	1059	145	128	11749	12001	76	104	7055	7055
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	740	689	0	0	7091	5109	0	0	3754	2648
Otros ^c	26	16	70	78	128	145	599	1802	104	76	363	1455
Total	42	42	1826	1826	273	273	19439	18912	180	180	11172	11158

^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