

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de octubre de 2024
Fecha de Información: 15 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\$3447 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.34%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	394,7	402,6	136,5	284,1	260,1	104,7	6,0
15-35	813,3	919,1	699,1	454,5	15,0	153,8	205,0
36-60	351,1	476,1	369,7	0,0	21,3	266,1	85,0
61-90	10,3	10,7	0,0	0,0	10,7	10,3	0,0
91-180	132,5	172,0	130,4	22,7	17,5	85,8	24,1
>180	39,7	45,2	40,3	27,6	5,0	12,0	0,0
Total	1741,6	2025,7	1376,1	788,9	329,5	632,6	320,1

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.67%	5.39%	5.31%	5.36%
15-35	5.54%	5.59%	5.32%	5.51%
36-60	5.19%	5.32%	5.17%	5.21%
61-90	—	5.56%	4.83%	5.20%
91-180	4.87%	4.95%	4.69%	4.79%
>180	—	4.84%	4.66%	4.71%
Total	5.40%	5.46%	5.19%	5.34%

^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	14 – 18 oct.				21 - 25 oct.				28 oct. - 01 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	120	127	8801	9317	63	185	8183	9463	64	218	6548	8587
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4965	3891	0	0	4703	2828	0	0	5105	2774
Otros ^c	127	120	1017	1556	185	63	832	1409	218	64	918	1176
Total	247	247	14783	14764	248	248	13718	13700	282	282	12571	12537

^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