

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2024
Fecha de Información: 17 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\$7053 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.86%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	1704,9	1523,0	498,4	1094,8	430,2	15,6	594,5
15-35	1603,7	2135,6	1497,0	713,8	16,1	267,4	622,5
36-60	72,7	88,2	30,0	0,0	8,2	22,7	50,0
61-90	24,8	48,0	45,4	15,9	2,6	8,9	0,0
91-180	641,6	356,7	302,4	200,0	14,2	401,6	40,0
>180	90,1	95,4	65,3	54,3	5,1	10,8	25,0
Total	4137,8	4246,9	2438,5	2078,7	476,5	727,1	1332,0

^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%		3.70%	3.60%	4.24%
15-35	5.65%		5.29%	5.06%	5.31%
36-60	5.60%		5.66%	4.96%	5.49%
61-90	—		5.50%	4.71%	4.89%
91-180	4.91%		4.94%	4.77%	4.79%
>180	4.70%		4.67%	4.63%	4.68%
Total	5.61%		4.87%	4.37%	4.86%

^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	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	50	63	3906	4036	75	195	10236	11110	85	221	6699	8868
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2669	2187	0	0	5246	4181	0	0	5220	2789
Otros ^c	63	50	142	492	195	75	1256	1427	221	85	960	1187
Total	113	113	6717	6715	270	270	16738	16718	306	306	12879	12844

^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