

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2024
Fecha de Información: 18 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\$4027 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.95%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	980,8	834,9	408,1	677,1	170,2	47,1	256,5
15-35	1007,3	1247,2	707,7	411,9	14,5	70,4	525,0
36-60	32,4	29,3	0,0	0,0	29,3	32,4	0,0
61-90	151,6	158,7	130,2	24,7	18,5	116,9	10,0
91-180	196,2	277,4	141,3	19,7	16,0	56,5	120,0
>180	19,0	13,9	3,6	2,4	0,3	6,6	10,0
Total	2387,3	2561,2	1390,9	1135,9	248,8	329,9	921,5

^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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	5.63%		4.88%	3.35%	4.40%
15-35	5.66%		5.23%	5.05%	5.35%
36-60	—		5.58%	5.03%	5.29%
61-90	5.29%		5.22%	5.07%	5.11%
91-180	5.14%		5.03%	4.76%	5.03%
>180	4.71%		5.08%	4.71%	4.72%
Total	5.57%		5.09%	4.23%	4.95%

^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	27	33	795	798	87	205	10977	11614	87	223	6920	9183
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	639	610	0	0	5547	4724	0	0	5271	2852
Otros ^c	33	27	55	81	205	87	1269	1435	223	87	1105	1228
Total	60	60	1489	1489	292	292	17793	17773	310	310	13296	13263

^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