

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2024
Fecha de Información: 21 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\$4270 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.25%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	913,0	641,8	320,1	611,2	39,7	19,8	282,0
15-35	797,0	1222,2	729,1	352,0	162,6	114,5	330,5
36-60	510,4	126,7	105,5	265,0	6,2	230,4	15,0
61-90	4,8	4,8	0,0	0,0	4,8	4,8	0,0
91-180	104,2	419,0	355,5	25,0	18,5	34,2	45,0
>180	99,4	109,7	98,3	80,6	1,4	8,7	10,0
Total	2428,8	2524,1	1608,5	1333,9	233,1	412,4	682,5

^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	5.68%		5.62%	4.35%	5.03%
15-35	5.60%		5.42%	5.23%	5.41%
36-60	5.31%		5.41%	5.29%	5.30%
61-90	—		5.12%	4.77%	4.94%
91-180	5.03%		5.03%	4.84%	5.01%
>180	4.76%		5.75%	4.68%	4.77%
Total	5.57%		5.37%	4.93%	5.25%

^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	21 - 25 oct.				28 oct. - 01 nov.				04 - 08 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	91	210	11488	12045	90	225	7017	9236	22	89	6136	7213
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5875	5160	0	0	5279	2901	0	0	4829	3073
Otros ^c	210	91	1300	1437	225	90	1109	1234	89	22	443	1078
Total	301	301	18663	18642	315	315	13405	13371	111	111	11408	11364

^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