

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2024
Fecha de Información: 22 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\$2799 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.99%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	513,0	455,0	316,3	392,7	54,7	36,4	84,0
15-35	503,0	635,1	243,5	304,3	223,4	30,5	168,2
36-60	60,3	236,4	173,8	6,3	17,6	9,0	45,0
61-90	2,9	4,1	0,0	0,0	4,1	2,9	0,0
91-180	352,2	179,9	108,5	127,8	24,6	177,5	46,8
>180	139,4	151,9	54,2	20,2	7,7	29,2	90,0
Total	1570,9	1662,4	896,2	851,3	332,1	285,5	434,1

^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	5.38%	3.87%	4.49%	4.37%
15-35	5.50%	5.58%	5.27%	5.45%
36-60	5.24%	5.34%	5.19%	5.29%
61-90	—	6.78%	5.06%	6.07%
91-180	4.98%	4.85%	4.96%	4.93%
>180	4.82%	5.08%	4.64%	4.81%
Total	5.25%	4.94%	4.90%	4.99%

^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	72	170	9470	10157	95	235	7131	9359	22	90	6187	7259
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4841	4083	0	0	5279	2931	0	0	4858	3073
Otros ^c	170	72	1103	1159	235	95	1158	1242	90	22	447	1115
Total	242	242	15414	15399	330	330	13568	13532	112	112	11492	11447

^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