

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2024
Fecha de Información: 25 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\$2686 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.01%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	535,6	352,5	208,6	440,5	87,6	38,8	56,2
15-35	643,0	604,6	474,6	388,3	41,2	165,9	88,8
36-60	26,3	28,2	20,0	20,0	8,2	6,3	0,0
61-90	58,3	41,4	12,8	28,7	8,6	9,7	20,0
91-180	122,4	335,0	279,0	10,9	26,0	81,6	30,0
>180	70,1	103,6	61,5	8,9	2,1	21,2	40,0
Total	1455,7	1465,3	1056,5	897,2	173,8	323,4	235,0

^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	5.27%	4.56%	4.78%	4.74%
15-35	5.27%	5.31%	5.29%	5.30%
36-60	—	5.38%	5.10%	5.17%
61-90	5.07%	5.20%	4.86%	5.05%
91-180	4.84%	4.85%	4.54%	4.78%
>180	4.76%	4.73%	4.66%	4.73%
Total	5.11%	4.99%	5.00%	5.01%

^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	16	38	1099	964	116	245	7934	10129	33	91	6654	7654
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	521	625	0	0	5604	3585	0	0	4890	3467
Otros ^c	38	16	63	93	245	116	1483	1270	91	33	747	1125
Total	54	54	1683	1682	361	361	15021	14984	124	124	12291	12246

^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