

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2024
Fecha de Información: 28 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\$4449 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.79%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	757,4	380,4	299,8	563,3	15,5	129,1	65
15-35	1209,2	1962,5	653,9	210,2	494,6	185,0	814
36-60	63,6	182,4	40,7	1,3	115,6	36,3	26
61-90	121,1	4,4	1,5	0,0	2,8	121,1	0
91-180	372,7	113,6	66,0	2,2	22,6	345,5	25
>180	149,1	163,3	62,4	41,9	0,8	7,1	100
Total	2673,0	2806,5	1124,4	818,9	652,0	824,1	1030

^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	5.07%		5.28%	4.12%	4.37%
15-35	5.12%		4.73%	5.09%	4.92%
36-60	5.03%		4.92%	4.99%	4.95%
61-90	—		4.99%	4.84%	4.84%
91-180	4.84%		5.15%	4.58%	4.63%
>180	4.79%		4.69%	4.61%	4.76%
Total	5.08%		4.79%	4.55%	4.79%

^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	28 oct. - 01 nov.				04 - 08 nov.				11 - 15 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	111	247	8625	10405	41	97	6761	7794	87	91	7213	7534
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5808	4101	0	0	4997	3541	0	0	4212	3304
Otros ^c	247	111	1489	1380	97	41	749	1127	91	87	1088	1644
Total	358	358	15922	15886	138	138	12507	12462	178	178	12513	12482

^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