

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de noviembre de 2024
Fecha de Información: 30 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\$4901 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.61%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	1061,9	566,6	379,9	878,7	32,2	28,7	154,5
15-35	1250,4	1803,2	922,8	548,6	295,8	117,3	584,5
36-60	202,2	205,3	146,1	98,9	14,2	58,3	45,0
61-90	25,0	38,3	0,0	0,0	38,3	25,0	0,0
91-180	92,1	128,3	90,0	52,9	0,0	29,2	10,0
>180	184,6	271,5	120,3	37,2	16,6	12,8	134,6
Total	2816,1	3013,2	1659,2	1616,2	397,1	271,3	928,6

^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	4.82%		4.56%	4.13%	4.32%
15-35	4.81%		4.88%	4.47%	4.78%
36-60	4.75%		4.19%	3.99%	4.22%
61-90	—		4.75%	4.60%	4.69%
91-180	4.60%		4.65%	4.52%	4.59%
>180	4.68%		4.56%	4.53%	4.63%
Total	4.79%		4.78%	4.26%	4.61%

^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	76	124	6912	7765	54	111	7177	7991	96	95	7858	8084
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4392	3641	0	0	5101	3858	0	0	4296	3668
Otros ^c	124	76	922	799	111	54	751	1135	95	96	1298	1669
Total	200	200	12226	12205	165	165	13029	12984	191	191	13452	13421

^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