

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de noviembre de 2024

Fecha de Información: 31 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\$4887 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.53%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	1096,6	633,8	361,4	947,9	157,8	34,1	114,6
15-35	895,7	1402,1	978,7	458,5	24,0	37,7	399,5
36-60	273,6	264,9	120,0	120,0	22,9	31,6	122,0
61-90	191,1	321,6	282,3	40,0	9,3	121,1	30,0
91-180	164,5	275,6	135,2	3,2	40,5	61,3	100,0
>180	107,6	40,7	12,3	81,5	13,4	11,1	15,0
Total	2729,2	2938,9	1889,9	1651,1	267,9	297,0	781,1

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.84%	4.85%	3.68%	4.07%
15-35	4.87%	4.73%	4.79%	4.78%
36-60	4.68%	4.76%	4.48%	4.69%
61-90	4.33%	4.47%	4.65%	4.56%
91-180	4.72%	4.52%	4.50%	4.58%
>180	4.62%	5.22%	4.59%	4.74%
Total	4.79%	4.73%	4.12%	4.53%

^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	57	47	5462	5814	57	115	7697	8495	98	96	7944	8329
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3662	3362	0	0	5485	4265	0	0	4367	3693
Otros ^c	47	57	394	335	115	57	760	1137	96	98	1435	1693
Total	104	104	9518	9511	172	172	13942	13897	194	194	13746	13715

^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