

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de noviembre de 2024

Fecha de Información: 05 de noviembre 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\$4008 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.88%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	1372,1	838,4	347,5	875,6	23,1	28,7	467,8
15-35	413,8	894,7	757,5	257,2	29,2	48,6	108,0
36-60	36,7	75,8	58,7	23,9	15,1	10,8	2,0
61-90	173,8	207,6	80,0	80,0	47,6	13,8	80,0
91-180	117,3	153,3	61,0	9,3	55,8	71,5	36,5
>180	225,6	308,4	192,6	65,8	0,8	44,7	115,0
Total	2339,3	2478,1	1497,3	1311,7	171,5	218,3	809,3

^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%	5.00%	4.64%	4.87%
15-35	5.10%	5.00%	5.00%	5.01%
36-60	4.95%	5.17%	4.77%	4.93%
61-90	4.63%	4.67%	4.55%	4.65%
91-180	4.86%	4.87%	4.61%	4.78%
>180	4.83%	4.75%	4.68%	4.76%
Total	4.99%	4.93%	4.73%	4.88%

^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	04 – 08 nov.				11 - 15 nov.				18 - 22 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	67	122	9301	9465	124	100	8455	8872	84	106	8349	9217
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6025	5432	0	0	4524	3896	0	0	5417	3509
Otros ^c	122	67	765	1149	100	124	1527	1704	106	84	742	1772
Total	189	189	16091	16046	224	224	14506	14472	190	190	14508	14498

^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