

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de noviembre de 2024
Fecha de Información: 06 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\$2702 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.05%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	584,7	414,8	238,2	413,0	27,6	22,7	149
15-35	760,0	939,5	565,7	378,9	35,8	43,1	338
36-60	19,9	98,9	62,0	0,0	32,0	14,9	5
61-90	14,1	8,3	0,0	0,0	8,3	14,1	0
91-180	100,2	106,9	50,0	16,2	20,9	48,0	36
>180	151,4	46,0	30,8	117,4	0,2	19,0	15
Total	1630,2	1614,4	946,6	925,5	124,8	161,7	543

^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	5.18%		5.29%	5.18%	5.21%
15-35	5.27%		5.16%	4.70%	5.07%
36-60	4.93%		5.44%	4.71%	5.18%
61-90	—		4.88%	4.49%	4.63%
91-180	4.86%		4.25%	4.66%	4.52%
>180	4.66%		4.68%	4.69%	4.68%
Total	5.20%		5.11%	4.89%	5.05%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{365/\text{Plazo}}}) - 1$. 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	49	98	7449	7707	132	107	8561	8984	89	106	8414	9350
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4972	4298	0	0	4605	3996	0	0	5496	3509
Otros ^c	98	49	445	810	107	132	1557	1710	106	89	759	1796
Total	147	147	12866	12815	239	239	14723	14690	195	195	14669	14655

^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