

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2024
Fecha de Información: 07 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\$3647 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.56%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	824,5	391,9	209,1	637,0	30,8	35,5	152,0
15-35	1328,6	1001,0	601,0	922,2	57,5	63,9	342,5
36-60	28,3	34,4	3,4	10,0	31,0	18,3	0,0
61-90	65,4	127,6	114,0	0,0	13,6	65,4	0,0
91-180	73,0	20,4	0,6	19,4	14,8	48,7	5,0
>180	138,4	143,1	105,3	103,0	7,8	5,4	30,0
Total	2458,3	1718,3	1033,4	1691,6	155,4	237,1	529,5

^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	5.07%	5.25%	4.39%	4.79%
15-35	5.10%	4.50%	4.18%	4.47%
36-60	—	5.30%	4.90%	5.15%
61-90	—	4.82%	4.73%	4.76%
91-180	4.76%	4.65%	4.62%	4.64%
>180	4.68%	4.21%	3.10%	4.10%
Total	5.07%	4.65%	4.26%	4.56%

^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	36	54	5527	5610	136	120	8897	9078	99	110	8779	9585
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3682	3250	0	0	4678	4321	0	0	5623	3759
Otros ^c	54	36	68	353	120	136	1567	1710	110	99	772	1816
Total	90	90	9277	9213	256	256	15142	15109	209	209	15174	15160

^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