

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2024
Fecha de Información: 08 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\$3113 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.62%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	583,5	547,2	282,8	373,7	108,4	53,8	156
15-35	1028,4	1516,7	826,7	317,0	33,1	54,4	657
36-60	43,7	54,9	25,7	20,0	9,2	3,7	20
61-90	60,3	66,1	20,0	20,0	11,1	5,3	35
91-180	14,3	16,8	0,0	0,0	16,8	14,3	0
>180	47,3	26,7	0,0	0,0	1,7	22,3	25
Total	1777,5	2228,4	1155,1	730,7	180,2	153,9	893

^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	4.81%		4.80%	4.55%	4.69%
15-35	4.84%		4.67%	3.90%	4.58%
36-60	5.08%		3.64%	4.63%	4.25%
61-90	4.96%		5.04%	4.52%	4.96%
91-180	—		4.76%	4.52%	4.65%
>180	4.59%		4.76%	4.55%	4.58%
Total	4.84%		4.70%	4.25%	4.62%

^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.

¹A 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.

²El 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	19	23	1158	1321	141	121	9103	9357	105	111	9052	9801
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	725	509	0	0	4892	4483	0	0	5643	3877
Otros ^c	23	19	33	62	121	141	1592	1714	111	105	852	1855
Total	42	42	1916	1892	262	262	15587	15554	216	216	15547	15533

^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