

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2024
Fecha de Información: 12 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\$2895 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.76%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	298,8	565,2	212,0	169,2	273,2	49,7	80,0
15-35	982,0	900,2	619,8	336,6	43,4	408,4	237,0
36-60	136,2	87,7	5,6	25,0	7,1	36,2	75,0
61-90	13,4	5,9	0,0	0,0	5,9	13,4	0,0
91-180	63,8	211,8	175,0	1,3	15,3	41,1	21,5
>180	31,5	17,5	10,0	16,7	2,5	9,8	5,0
Total	1525,7	1788,2	1022,4	548,8	347,4	558,4	418,5

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	4.89%		5.05%	4.54%	4.91%
15-35	4.75%		4.66%	4.72%	4.71%
36-60	4.87%		4.99%	4.71%	4.83%
61-90	—		4.94%	4.58%	4.69%
91-180	4.66%		4.73%	4.47%	4.67%
>180	4.47%		8.87%	4.40%	4.87%
Total	4.79%		4.83%	4.68%	4.76%

^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	11 - 15 nov.				18 - 22 nov.				25 - 29 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	148	121	9323	9592	113	122	9225	10161	78	310	6528	7451
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5069	4656	0	0	5655	3937	0	0	4558	2993
Otros ^c	121	148	1602	1711	122	113	1111	1879	310	78	514	1143
Total	269	269	15994	15959	235	235	15991	15977	388	388	11600	11587

^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