

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2024
Fecha de Información: 13 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\$3355 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.60%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	759,6	493,7	233,0	456,1	48,2	90,9	212,5
15-35	700,2	1162,9	848,4	325,0	52,0	112,7	262,5
36-60	80,0	77,9	30,0	30,0	17,9	20,0	30,0
61-90	98,4	59,0	21,9	10,0	12,2	63,4	25,0
91-180	32,4	238,1	201,2	4,6	31,5	22,4	5,4
>180	137,7	66,1	42,6	26,4	7,5	95,3	16,0
Total	1808,4	2097,6	1377,1	852,2	169,1	404,8	551,4

^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	5.06%		5.00%	3.59%	4.30%
15-35	5.06%		5.06%	4.91%	5.02%
36-60	5.06%		5.20%	4.54%	5.02%
61-90	4.76%		4.95%	4.59%	4.72%
91-180	4.77%		2.30%	4.46%	2.69%
>180	4.48%		4.56%	4.28%	4.37%
Total	5.03%		4.62%	4.31%	4.60%

^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	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	128	102	7704	8104	127	125	9489	10242	83	312	6652	7585
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4669	4254	0	0	5670	4115	0	0	4585	3013
Otros ^c	102	128	1119	1101	125	127	1137	1925	312	83	529	1155
Total	230	230	13492	13459	252	252	16296	16282	395	395	11766	11753

^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