

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2024
Fecha de Información: 15 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\$3598 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.27%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	865,9	1048,2	418,3	394,5	192,9	34,4	437
15-35	1167,0	1149,9	415,5	287,9	89,4	234,1	645
36-60	2,6	9,1	4,7	0,0	4,4	2,6	0
61-90	189,4	38,4	0,0	64,0	13,4	100,4	25
91-180	67,0	114,8	50,0	0,0	24,8	27,0	40
>180	63,2	41,2	25,3	27,0	3,9	24,2	12
Total	2355,1	2401,6	913,8	773,4	328,8	422,6	1159

^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	5.35%		5.46%	5.18%	5.36%
15-35	5.31%		5.31%	5.35%	5.32%
36-60	—		5.27%	4.88%	5.18%
61-90	4.98%		5.34%	4.89%	4.95%
91-180	4.91%		4.89%	4.61%	4.83%
>180	4.56%		4.57%	4.46%	4.52%
Total	5.30%		5.32%	5.18%	5.27%

^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	43	50	343	480	139	130	10679	11607	94	312	6691	7702
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	298	202	0	0	6104	4745	0	0	4658	3016
Otros ^c	50	43	127	86	130	139	1542	1957	312	94	556	1172
Total	93	93	768	768	269	269	18325	18309	406	406	11905	11890

^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