

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de octubre de 2024
Fecha de Información: 01 de octubre 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\$5784 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.84%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2090,9	1273,0	378,5	1170,6	5,4	31,3	889,0
15-35	983,8	1920,7	1195,7	248,1	28,9	0,0	735,7
36-60	128,0	196,4	128,3	24,4	8,1	43,6	60,0
61-90	468,8	500,6	39,4	0,0	1,1	8,8	460,0
91-180	31,2	14,9	0,3	0,0	14,6	31,2	0,0
>180	185,4	160,4	134,5	155,2	0,9	5,1	25,0
Total	3888,1	4066,0	1876,8	1598,3	59,1	120,1	2169,7

^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	5.06%	3.80%	4.71%	4.85%
15-35	5.03%	4.84%	4.25%	4.83%
36-60	4.92%	5.01%	4.77%	4.91%
61-90	4.84%	4.85%	4.25%	4.83%
91-180	–	4.82%	4.69%	4.73%
>180	4.80%	5.07%	4.40%	4.74%
Total	4.99%	4.78%	4.60%	4.84%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards^a

Sectores	30 sept. - 04 oct.				07 - 11 oct.				14 - 18 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	70	100	8259	8504	105	107	10250	10686	71	107	6946	6815
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4904	4068	0	0	6329	3995	0	0	3581	2597
Otros ^c	100	70	873	1460	107	105	398	1770	107	71	327	1427
Total	170	170	14036	14032	212	212	16977	16451	178	178	10854	10839

^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