

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de octubre de 2024
Fecha de Información: 02 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\$4310 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.01%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	997,1	906,7	434,4	667,9	171,2	28,2	301,0
15-35	1043,1	1095,4	557,5	473,0	35,9	68,0	502,0
36-60	118,3	8,9	0,0	0,0	8,5	117,9	0,4
61-90	154,2	199,7	189,8	75,0	9,9	79,2	0,0
91-180	200,6	182,5	161,1	84,9	10,5	104,7	11,0
>180	154,7	138,0	60,8	50,3	2,2	29,4	75,0
Total	2668,0	2531,3	1403,6	1351,1	238,3	427,6	889,4

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.18%	5.20%	4.93%	5.10%
15-35	5.18%	4.93%	4.90%	5.02%
36-60	4.98%	5.11%	4.98%	4.99%
61-90	–	4.98%	4.83%	4.86%
91-180	4.83%	4.93%	4.81%	4.84%
>180	4.85%	4.89%	4.75%	4.83%
Total	5.15%	5.02%	4.90%	5.01%

^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	59	94	7401	7325	107	118	10560	11187	72	107	7027	6850
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4077	3627	0	0	6479	4101	0	0	3581	2648
Otros ^c	94	59	840	1365	118	107	555	1779	107	72	345	1440
Total	153	153	12318	12317	225	225	17594	17067	179	179	10953	10938

^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