

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2024
Fecha de Información: 23 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\$3597 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.86%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	378,8	743,1	410,9	300,1	277,7	24,2	54,5
15-35	648,4	1088,5	700,5	419,8	213,5	54,1	174,5
36-60	61,0	3,9	0,0	44,0	3,9	17,0	0,0
61-90	67,0	94,8	25,0	0,0	14,8	12,0	55,0
91-180	544,4	115,0	60,1	1,3	14,9	503,1	40,0
>180	101,8	114,3	69,8	13,5	4,5	48,4	40,0
Total	1801,5	2159,6	1266,3	778,7	529,3	658,8	364,0

^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	5.16%	4.04%	5.13%	4.38%
15-35	5.22%	5.27%	5.18%	5.23%
36-60	–	5.49%	4.96%	5.06%
61-90	5.08%	5.05%	4.71%	5.03%
91-180	4.88%	4.91%	4.73%	4.76%
>180	4.74%	4.91%	4.55%	4.65%
Total	5.10%	4.73%	4.96%	4.86%

^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	21 – 25 oct.				28 oct. - 01 nov.				04 - 08 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	59	142	6334	7157	103	236	7271	9721	25	90	6475	7299
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3904	3038	0	0	5329	3025	0	0	4870	3332
Otros ^c	142	59	573	609	236	103	1434	1254	90	25	448	1117
Total	201	201	10811	10804	339	339	14034	14000	115	115	11793	11748

^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