

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de diciembre de 2024
Fecha de Información: 04 de diciembre 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\$4729 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.91%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	1059,4	992,1	641,4	926,8	257,7	39,6	93,0
15-35	849,2	816,1	564,3	578,5	27,4	46,3	224,4
36-60	114,7	166,0	97,5	50,0	18,5	14,7	50,0
61-90	355,6	440,8	350,1	107,8	0,0	184,8	63,0
91-180	115,0	39,5	0,1	35,0	39,4	80,0	0,0
>180	117,9	162,6	90,1	47,5	2,5	0,4	70,0
Total	2611,8	2617,2	1743,5	1745,6	345,5	365,8	500,4

^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	5.15%	5.25%	4.73%	5.01%
15-35	5.43%	5.18%	4.48%	4.92%
36-60	5.10%	5.26%	5.07%	5.18%
61-90	4.90%	4.44%	4.86%	4.65%
91-180	–	4.82%	4.78%	4.79%
>180	4.56%	4.47%	4.46%	4.53%
Total	5.15%	5.06%	4.67%	4.91%

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

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards^a

Sectores	02 – 06 dic.				09 - 13 dic.				16 - 20 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	70	60	5394	5357	202	133	8903	10068	64	132	10254	12041
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3311	3199	0	0	6018	3692	0	0	6813	3591
Otros ^c	60	70	255	389	133	202	1101	1769	132	64	809	2228
Total	130	130	8960	8945	335	335	16022	15529	196	196	17876	17860

^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