

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de octubre de 2024
Fecha de Información: 08 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\$3748 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.26%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	912,9	722,6	493,7	683,5	65,4	65,9	163,4
15-35	711,7	991,9	640,9	327,0	10,5	44,2	340,5
36-60	413,5	462,7	58,1	37,5	43,6	15,0	361,0
61-90	13,9	5,6	0,0	0,0	5,6	13,9	0,0
91-180	63,0	180,5	135,4	6,4	30,1	41,5	15,0
>180	71,5	118,3	77,7	21,9	0,0	9,0	40,6
Total	2186,4	2481,7	1405,9	1076,3	155,2	189,6	920,5

^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	5.39%		6.15%	4.68%	5.29%
15-35	5.45%		5.47%	5.02%	5.36%
36-60	5.26%		5.35%	4.56%	5.25%
61-90	—		5.12%	4.80%	4.89%
91-180	4.91%		4.72%	4.78%	4.76%
>180	4.73%		4.65%	4.59%	4.68%
Total	5.32%		5.52%	4.82%	5.26%

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

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards^a

Sectores	07 - 11 oct.				14 - 18 oct.				21 - 25 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	151	108	11388	11114	84	120	7328	7698	25	174	7597	8386
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6486	5464	0	0	3992	2765	0	0	4225	2644
Otros ^c	108	151	740	1504	120	84	667	1505	174	25	537	1310
Total	259	259	18614	18082	204	204	11987	11968	199	199	12359	12340

^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