

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2024
Fecha de Información: 10 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\$4459 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.08%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	1107,2	1094,4	692,2	764,8	74,2	14,4	328,0
15-35	922,0	1052,2	619,1	404,4	23,0	107,5	410,1
36-60	13,8	21,2	0,0	0,0	20,9	13,5	0,3
61-90	260,0	203,5	134,8	194,8	3,7	0,2	65,0
91-180	125,2	336,0	242,2	7,5	3,8	27,8	90,0
>180	146,3	168,5	67,3	46,2	3,1	2,0	98,1
Total	2574,5	2875,8	1755,5	1417,7	128,8	165,3	991,5

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.53%	5.18%	3.96%	4.98%
15-35	5.47%	5.52%	4.79%	5.27%
36-60	5.20%	5.47%	5.12%	5.33%
61-90	5.16%	4.51%	5.19%	4.94%
91-180	4.98%	4.66%	4.82%	4.80%
>180	4.74%	4.71%	4.69%	4.73%
Total	5.35%	5.21%	4.60%	5.08%

^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	120	62	6540	6480	92	124	8152	8081	29	174	7953	9049
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4306	4096	0	0	4074	3347	0	0	4547	2697
Otros ^c	61	120	518	788	123	92	733	1531	174	29	610	1363
Total	181	182	11364	11364	215	216	12959	12959	203	203	13110	13109

^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