

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2024
Fecha de Información: 11 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\$3878 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.92%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	454,2	1237,6	891,0	353,7	271,7	25,6	74,9
15-35	857,5	617,6	357,8	636,0	65,9	27,5	194,0
36-60	44,1	26,6	0,0	33,0	24,8	9,3	1,8
61-90	305,9	135,0	48,0	223,4	7,0	2,5	80,0
91-180	228,1	140,9	83,6	0,0	57,3	228,1	0,0
>180	139,3	148,7	36,3	6,5	5,9	26,3	106,5
Total	2029,0	2306,4	1416,7	1252,6	432,6	319,3	457,2

^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	6.04%		4.63%	3.90%	4.51%
15-35	5.53%		5.34%	5.30%	5.38%
36-60	5.43%		5.60%	4.64%	5.35%
61-90	5.19%		4.99%	4.93%	5.15%
91-180	—		4.96%	4.79%	4.85%
>180	4.66%		5.01%	4.72%	4.69%
Total	5.35%		4.96%	4.58%	4.92%

^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	100	30	2383	2470	105	133	8542	9205	35	174	8064	9166
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1681	1576	0	0	4915	3679	0	0	4608	2747
Otros ^c	30	100	96	107	133	105	961	1514	174	35	631	1372
Total	130	130	4160	4153	238	238	14418	14398	209	209	13303	13285

^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