

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de noviembre de 2024

Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$3859 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.51%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	1031,1	901,7	546,0	736,6	95,3	34,0	260,5
15-35	907,4	1057,7	550,8	438,0	99,3	61,9	407,5
36-60	20,4	19,4	13,5	13,5	5,9	6,9	0,0
61-90	99,0	104,3	69,7	58,8	4,6	10,1	30,0
91-180	141,2	309,5	221,1	0,6	0,0	0,0	140,6
>180	55,3	70,6	45,6	26,1	5,2	9,3	19,8
Total	2254,3	2463,2	1446,7	1273,7	210,3	122,3	858,4

^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	4.86%	4.57%	3.57%	4.20%
15-35	4.86%	4.72%	4.53%	4.71%
36-60	—	4.81%	4.50%	4.73%
61-90	4.58%	4.60%	4.69%	4.62%
91-180	4.68%	4.61%	4.61%	4.61%
>180	4.68%	4.69%	4.66%	4.68%
Total	4.84%	4.66%	4.11%	4.51%

^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	28 oct. - 01 nov.				04 - 08 nov.				11 - 15 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	25	24	977	1009	66	121	8548	9209	107	96	8091	8515
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	710	642	0	0	5949	4859	0	0	4440	3803
Otros ^c	24	25	63	95	121	66	762	1145	96	107	1524	1705
Total	49	49	1750	1746	187	187	15259	15213	203	203	14055	14023

^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