

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2024
Fecha de Información: 14 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\$3443 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.12%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	432,2	509,0	158,6	293,5	245,9	34,2	104,5
15-35	1444,8	1382,2	697,1	485,3	24,1	298,5	661,0
36-60	7,8	5,1	0,0	0,0	3,1	5,8	2,0
61-90	25,8	51,5	40,0	0,0	4,5	18,8	7,0
91-180	93,3	195,6	150,0	0,0	25,6	73,3	20,0
>180	40,2	64,7	10,0	1,8	39,7	23,3	15,1
Total	2044,2	2208,0	1055,7	780,6	342,8	454,0	809,6

^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	5.27%		5.19%	5.31%	5.25%
15-35	5.29%		5.33%	4.92%	5.18%
36-60	5.08%		5.08%	4.61%	4.83%
61-90	4.98%		4.98%	4.73%	4.89%
91-180	4.91%		4.32%	4.69%	4.47%
>180	4.66%		4.86%	4.41%	4.70%
Total	5.26%		5.12%	4.99%	5.12%

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

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards^a

Sectores	11 - 15 nov.				18 - 22 nov.				25 - 29 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	107	77	5442	5732	133	127	10049	10743	87	312	6664	7663
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3545	3209	0	0	5692	4410	0	0	4650	3013
Otros ^c	77	107	527	559	127	133	1367	1939	312	87	542	1166
Total	184	184	9514	9500	260	260	17108	17092	399	399	11856	11842

^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