

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2024
Fecha de Información: 16 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\$4075 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.10%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	978,3	786,9	594,8	778,1	37,1	45,2	155,0
15-35	794,8	1436,6	889,5	338,8	138,6	47,5	408,5
36-60	65,4	28,9	0,0	0,0	4,9	41,4	24,0
61-90	45,9	276,7	239,5	0,0	10,7	19,4	26,5
91-180	115,4	141,5	22,0	9,9	34,5	20,6	85,0
>180	68,0	60,6	33,9	29,1	1,7	13,8	25,0
Total	2067,8	2731,3	1779,8	1155,9	227,6	187,9	724,0

^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	5.55%	4.80%	3.86%	4.51%
15-35	5.58%	5.61%	5.46%	5.58%
36-60	5.52%	5.03%	5.10%	5.24%
61-90	5.18%	5.21%	4.80%	5.10%
91-180	4.94%	4.91%	4.73%	4.90%
>180	4.69%	4.65%	4.57%	4.65%
Total	5.45%	5.30%	4.38%	5.10%

^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	14 – 18 oct.				21 - 25 oct.				28 oct. - 01 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	93	98	7150	7653	71	188	8955	9984	67	220	6586	8716
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4057	3208	0	0	4871	3238	0	0	5183	2789
Otros ^c	98	93	775	1113	188	71	840	1427	220	67	951	1182
Total	191	191	11982	11974	259	259	14666	14649	287	287	12720	12687

^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