

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de octubre de 2024**

**Fecha de Información: 27 de septiembre de 2024<sup>1</sup>**

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\$3855 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.93%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	966,9	1038,4	460,0	626,0	280,9	43,3	297,5
15-35	1019,9	965,5	317,0	378,2	79,5	72,7	569,0
36-60	24,9	20,3	2,8	0,0	17,5	24,9	0,0
61-90	8,0	56,5	38,7	0,0	17,8	8,0	0,0
91-180	284,7	277,6	251,2	10,0	26,4	274,7	0,0
>180	25,4	43,1	22,6	15,2	10,6	0,2	10,0
<b>Total</b>	<b>2329,8</b>	<b>2401,4</b>	<b>1092,3</b>	<b>1029,5</b>	<b>432,6</b>	<b>423,8</b>	<b>876,5</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	5.04%	4.85%	4.27%	4.78%
15-35	5.09%	5.10%	4.95%	5.05%
36-60	—	5.12%	4.88%	4.99%
61-90	—	5.00%	4.42%	4.87%
91-180	—	4.91%	4.80%	4.85%
>180	4.84%	4.89%	4.78%	4.86%
<b>Total</b>	<b>5.07%</b>	<b>4.96%</b>	<b>4.75%</b>	<b>4.93%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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<sup>a</sup>

Sectores	23 – 27 sept.				30 sept. - 04 oct.				07 - 11 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	15	92	1373	1519	91	108	8055	8950	93	101	9177	9801
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	806	663	0	0	5048	3595	0	0	6257	3695
Otros <sup>c</sup>	92	15	381	379	108	91	959	1514	101	93	339	1756
<b>Total</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>2560</b>	<b>2561</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>14062</b>	<b>14059</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>15773</b>	<b>15252</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.<sup>b</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.<sup>c</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes