

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 11 de octubre 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\$3878 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.92%<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	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
<b>Total</b>	<b>2029,0</b>	<b>2306,4</b>	<b>1416,7</b>	<b>1252,6</b>	<b>432,6</b>	<b>319,3</b>	<b>457,2</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
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%
<b>Total</b>	<b>5.35%</b>	<b>4.96%</b>	<b>4.58%</b>	<b>4.92%</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	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 <sup>b</sup>	0	0	1681	1576	0	0	4915	3679	0	0	4608	2747
Otros <sup>c</sup>	30	100	96	107	133	105	961	1514	174	35	631	1372
<b>Total</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>4160</b>	<b>4153</b>	<b>238</b>	<b>238</b>	<b>14418</b>	<b>14398</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>13303</b>	<b>13285</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