

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 26 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\$3228 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.97%<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	920,6	660,4	494,9	761,4	22,5	16,2	143,0
15-35	523,1	736,5	360,0	131,8	35,5	50,4	341,0
36-60	209,9	169,6	0,0	25,0	8,9	24,1	160,8
61-90	45,3	208,4	201,5	42,4	6,9	3,0	0,0
91-180	100,6	86,5	49,7	70,7	36,8	29,9	0,0
>180	131,1	130,7	77,3	80,2	3,5	0,9	50,0
<b>Total</b>	<b>1930,6</b>	<b>1992,2</b>	<b>1183,4</b>	<b>1111,4</b>	<b>114,1</b>	<b>124,5</b>	<b>694,8</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	5.11%	4.46%	4.73%	4.80%
15-35	5.08%	5.11%	4.99%	5.07%
36-60	5.01%	5.52%	4.89%	5.02%
61-90	—	4.42%	4.79%	4.49%
91-180	—	4.89%	4.91%	4.90%
>180	4.88%	5.14%	4.84%	4.90%
<b>Total</b>	<b>5.05%</b>	<b>4.97%</b>	<b>4.85%</b>	<b>4.97%</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	35	159	4784	4956	87	142	7529	8215	65	105	8980	9684
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2811	2753	0	0	4607	3087	0	0	6247	3600
Otros <sup>c</sup>	159	35	668	554	142	87	687	1518	105	65	332	1753
<b>Total</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>8263</b>	<b>8263</b>	<b>229</b>	<b>229</b>	<b>12823</b>	<b>12820</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>15559</b>	<b>15037</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