

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 04 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\$3445 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.68%<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	750,6	628,8	499,2	600,6	24,1	44,5	105,5
15-35	722,4	625,6	391,5	493,8	64,1	58,6	170,0
36-60	5,7	38,5	0,0	0,0	38,5	5,7	0,0
61-90	15,3	99,6	89,8	13,0	9,8	2,3	0,0
91-180	130,9	78,6	24,7	104,6	28,8	1,4	25,0
>180	351,2	382,8	297,4	265,5	0,8	1,1	84,6
<b>Total</b>	<b>1976,1</b>	<b>1853,9</b>	<b>1302,6</b>	<b>1477,4</b>	<b>166,2</b>	<b>113,6</b>	<b>385,1</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	4.42%		5.40%	3.62%	4.32%
15-35	5.18%		4.82%	4.65%	4.80%
36-60	—		5.19%	4.95%	5.16%
61-90	—		4.99%	4.88%	4.99%
91-180	4.92%		5.11%	4.84%	4.99%
>180	4.80%		4.77%	4.82%	4.80%
<b>Total</b>	<b>4.88%</b>		<b>5.00%</b>	<b>4.30%</b>	<b>4.68%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards<sup>a</sup>

Sectores	30 sept. - 04 oct.				07 - 11 oct.				14 - 18 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	16	26	1016	1059	145	128	11749	12001	76	104	7055	7055
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	740	689	0	0	7091	5109	0	0	3754	2648
Otros <sup>c</sup>	26	16	70	78	128	145	599	1802	104	76	363	1455
<b>Total</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>1826</b>	<b>1826</b>	<b>273</b>	<b>273</b>	<b>19439</b>	<b>18912</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>11172</b>	<b>11158</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