

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 09 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 07 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\$4006 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.83%<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	862,4	1028,6	478,4	777,5	490,2	24,9	60,0
15-35	504,5	675,7	503,1	315,2	14,1	30,8	158,5
36-60	392,8	219,8	160,6	252,0	4,2	85,8	55,0
61-90	1,1	11,3	0,0	0,0	11,3	1,1	0,0
91-180	234,5	285,4	272,0	8,0	12,8	225,9	0,7
>180	44,6	29,1	19,0	19,1	0,1	15,5	10,0
<b>Total</b>	<b>2039,9</b>	<b>2250,0</b>	<b>1433,2</b>	<b>1371,7</b>	<b>532,6</b>	<b>384,0</b>	<b>284,2</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.38%		3.94%	4.86%	4.35%
15-35	5.38%		5.36%	5.24%	5.34%
36-60	5.12%		5.13%	5.27%	5.19%
61-90	—		5.19%	4.76%	5.15%
91-180	4.82%		5.03%	4.79%	4.81%
>180	4.75%		4.95%	4.71%	4.72%
<b>Total</b>	<b>5.30%</b>		<b>4.61%</b>	<b>4.95%</b>	<b>4.83%</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	157	128	12490	12671	79	105	7127	7393	23	171	7550	8244
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	7502	5786	0	0	3821	2717	0	0	4148	2638
Otros <sup>c</sup>	128	157	818	1827	105	79	633	1458	171	23	511	1309
<b>Total</b>	<b>285</b>	<b>285</b>	<b>20810</b>	<b>20284</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>11581</b>	<b>11568</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>12209</b>	<b>12191</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