

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 09 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\$5284 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.30%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1098,2	817,6	492,9	804,9	54,7	23,3	270
15-35	1100,2	1028,4	842,6	874,9	18,7	58,4	167
36-60	172,0	240,2	140,0	73,8	15,2	13,2	85
61-90	171,7	613,9	530,8	110,0	23,1	1,7	60
91-180	161,2	306,1	262,5	36,0	13,6	95,2	30
>180	94,1	106,9	91,5	73,8	0,4	5,3	15
<b>Total</b>	<b>2797,5</b>	<b>3113,1</b>	<b>2360,3</b>	<b>1973,4</b>	<b>125,8</b>	<b>197,1</b>	<b>627</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	5.64%	5.54%	4.75%	5.17%
15-35	5.62%	5.56%	5.45%	5.54%
36-60	5.16%	5.25%	4.63%	5.19%
61-90	5.16%	5.10%	5.14%	5.13%
91-180	4.90%	5.02%	4.83%	4.92%
>180	4.81%	5.18%	4.30%	4.69%
<b>Total</b>	<b>5.47%</b>	<b>5.47%</b>	<b>4.97%</b>	<b>5.30%</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	129	93	10262	9493	87	121	7628	7966	27	175	7759	8639
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5787	5292	0	0	4041	2888	0	0	4353	2654
Otros <sup>c</sup>	93	129	607	1344	121	87	716	1511	175	27	541	1342
<b>Total</b>	<b>222</b>	<b>222</b>	<b>16656</b>	<b>16129</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>12385</b>	<b>12365</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>12653</b>	<b>12635</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