

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 17 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\$7053 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.86%<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	1704,9	1523,0	498,4	1094,8	430,2	15,6	594,5
15-35	1603,7	2135,6	1497,0	713,8	16,1	267,4	622,5
36-60	72,7	88,2	30,0	0,0	8,2	22,7	50,0
61-90	24,8	48,0	45,4	15,9	2,6	8,9	0,0
91-180	641,6	356,7	302,4	200,0	14,2	401,6	40,0
>180	90,1	95,4	65,3	54,3	5,1	10,8	25,0
<b>Total</b>	<b>4137,8</b>	<b>4246,9</b>	<b>2438,5</b>	<b>2078,7</b>	<b>476,5</b>	<b>727,1</b>	<b>1332,0</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	5.67%	3.70%	3.60%	4.24%
15-35	5.65%	5.29%	5.06%	5.31%
36-60	5.60%	5.66%	4.96%	5.49%
61-90	—	5.50%	4.71%	4.89%
91-180	4.91%	4.94%	4.77%	4.79%
>180	4.70%	4.67%	4.63%	4.68%
<b>Total</b>	<b>5.61%</b>	<b>4.87%</b>	<b>4.37%</b>	<b>4.86%</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	14 – 18 oct.				21 - 25 oct.				28 oct. - 01 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	50	63	3906	4036	75	195	10236	11110	85	221	6699	8868
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2669	2187	0	0	5246	4181	0	0	5220	2789
Otros <sup>c</sup>	63	50	142	492	195	75	1256	1427	221	85	960	1187
<b>Total</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>6717</b>	<b>6715</b>	<b>270</b>	<b>270</b>	<b>16738</b>	<b>16718</b>	<b>306</b>	<b>306</b>	<b>12879</b>	<b>12844</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