

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 18 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\$4027 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.95%<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	980,8	834,9	408,1	677,1	170,2	47,1	256,5
15-35	1007,3	1247,2	707,7	411,9	14,5	70,4	525,0
36-60	32,4	29,3	0,0	0,0	29,3	32,4	0,0
61-90	151,6	158,7	130,2	24,7	18,5	116,9	10,0
91-180	196,2	277,4	141,3	19,7	16,0	56,5	120,0
>180	19,0	13,9	3,6	2,4	0,3	6,6	10,0
<b>Total</b>	<b>2387,3</b>	<b>2561,2</b>	<b>1390,9</b>	<b>1135,9</b>	<b>248,8</b>	<b>329,9</b>	<b>921,5</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	5.63%	4.88%	3.35%	4.40%
15-35	5.66%	5.23%	5.05%	5.35%
36-60	—	5.58%	5.03%	5.29%
61-90	5.29%	5.22%	5.07%	5.11%
91-180	5.14%	5.03%	4.76%	5.03%
>180	4.71%	5.08%	4.71%	4.72%
<b>Total</b>	<b>5.57%</b>	<b>5.09%</b>	<b>4.23%</b>	<b>4.95%</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	27	33	795	798	87	205	10977	11614	87	223	6920	9183
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	639	610	0	0	5547	4724	0	0	5271	2852
Otros <sup>c</sup>	33	27	55	81	205	87	1269	1435	223	87	1105	1228
<b>Total</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>1489</b>	<b>1489</b>	<b>292</b>	<b>292</b>	<b>17793</b>	<b>17773</b>	<b>310</b>	<b>310</b>	<b>13296</b>	<b>13263</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