

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 21 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\$4270 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.25%<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	913,0	641,8	320,1	611,2	39,7	19,8	282,0
15-35	797,0	1222,2	729,1	352,0	162,6	114,5	330,5
36-60	510,4	126,7	105,5	265,0	6,2	230,4	15,0
61-90	4,8	4,8	0,0	0,0	4,8	4,8	0,0
91-180	104,2	419,0	355,5	25,0	18,5	34,2	45,0
>180	99,4	109,7	98,3	80,6	1,4	8,7	10,0
<b>Total</b>	<b>2428,8</b>	<b>2524,1</b>	<b>1608,5</b>	<b>1333,9</b>	<b>233,1</b>	<b>412,4</b>	<b>682,5</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.68%	5.62%	4.35%	5.03%
15-35	5.60%	5.42%	5.23%	5.41%
36-60	5.31%	5.41%	5.29%	5.30%
61-90	—	5.12%	4.77%	4.94%
91-180	5.03%	5.03%	4.84%	5.01%
>180	4.76%	5.75%	4.68%	4.77%
<b>Total</b>	<b>5.57%</b>	<b>5.37%</b>	<b>4.93%</b>	<b>5.25%</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	21 – 25 oct.				28 oct. - 01 nov.				04 - 08 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	91	210	11488	12045	90	225	7017	9236	22	89	6136	7213
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5875	5160	0	0	5279	2901	0	0	4829	3073
Otros <sup>c</sup>	210	91	1300	1437	225	90	1109	1234	89	22	443	1078
<b>Total</b>	<b>301</b>	<b>301</b>	<b>18663</b>	<b>18642</b>	<b>315</b>	<b>315</b>	<b>13405</b>	<b>13371</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>11408</b>	<b>11364</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