

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 24 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\$4175 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.89%<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         | 896,1                          | 576,9         | 98,3                                | 656,8         | 271,3         | 32,0         | 207,3                                |
| 15-35        | 911,6                          | 1172,8        | 665,4                               | 327,4         | 41,0          | 117,8        | 466,4                                |
| 36-60        | 98,0                           | 136,3         | 71,0                                | 32,8          | 10,4          | 10,3         | 54,9                                 |
| 61-90        | 55,4                           | 43,8          | 20,5                                | 11,4          | 8,2           | 29,0         | 15,0                                 |
| 91-180       | 525,2                          | 556,5         | 329,4                               | 22,9          | 22,1          | 297,3        | 205,0                                |
| >180         | 43,8                           | 107,3         | 93,8                                | 32,5          | 13,4          | 11,2         | 0,0                                  |
| <b>Total</b> | <b>2530,2</b>                  | <b>2593,6</b> | <b>1278,5</b>                       | <b>1083,8</b> | <b>366,6</b>  | <b>497,8</b> | <b>948,6</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         | 5.32%   | 3.21%                        | 4.33%        | 4.18%        |
| 15-35        | 5.44%   | 5.44%                        | 5.34%        | 5.42%        |
| 36-60        | 5.27%   | 5.26%                        | 5.08%        | 5.24%        |
| 61-90        | 5.08%   | 5.29%                        | 4.82%        | 4.97%        |
| 91-180       | 4.96%   | 4.96%                        | 4.55%        | 4.81%        |
| >180         | –   | 5.03%                        | 4.68%        | 4.97%        |
| <b>Total</b> | <b>5.29%</b>                                      | <b>4.77%</b>                 | <b>4.69%</b> | <b>4.89%</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                    | 40           | 109        | 4322        | 4710        | 107               | 240        | 7529         | 9897         | 28           | 90         | 6616         | 7573         |
| Intragruppo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0          | 2516        | 2127        | 0                 | 0          | 5425         | 3219         | 0            | 0          | 4890         | 3465         |
| Otros <sup>c</sup>                   | 109          | 40         | 359         | 354         | 240               | 107        | 1454         | 1254         | 90           | 28         | 697          | 1121         |
| <b>Total</b>                         | <b>149</b>   | <b>149</b> | <b>7197</b> | <b>7191</b> | <b>347</b>        | <b>347</b> | <b>14408</b> | <b>14370</b> | <b>118</b>   | <b>118</b> | <b>12203</b> | <b>12159</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