

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de noviembre de 2024**  
**Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$3859 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.51%<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	1031,1	901,7	546,0	736,6	95,3	34,0	260,5
15-35	907,4	1057,7	550,8	438,0	99,3	61,9	407,5
36-60	20,4	19,4	13,5	13,5	5,9	6,9	0,0
61-90	99,0	104,3	69,7	58,8	4,6	10,1	30,0
91-180	141,2	309,5	221,1	0,6	0,0	0,0	140,6
>180	55,3	70,6	45,6	26,1	5,2	9,3	19,8
<b>Total</b>	<b>2254,3</b>	<b>2463,2</b>	<b>1446,7</b>	<b>1273,7</b>	<b>210,3</b>	<b>122,3</b>	<b>858,4</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	4.86%		4.57%	3.57%	4.20%
15-35	4.86%		4.72%	4.53%	4.71%
36-60	—		4.81%	4.50%	4.73%
61-90	4.58%		4.60%	4.69%	4.62%
91-180	4.68%		4.61%	4.61%	4.61%
>180	4.68%		4.69%	4.66%	4.68%
<b>Total</b>	<b>4.84%</b>		<b>4.66%</b>	<b>4.11%</b>	<b>4.51%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards<sup>a</sup>

Sectores	28 oct. - 01 nov.				04 - 08 nov.				11 - 15 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	25	24	977	1009	66	121	8548	9209	107	96	8091	8515
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	710	642	0	0	5949	4859	0	0	4440	3803
Otros <sup>c</sup>	24	25	63	95	121	66	762	1145	96	107	1524	1705
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>1750</b>	<b>1746</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>15259</b>	<b>15213</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>14055</b>	<b>14023</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