

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 25 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\$2686 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.01%<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	535,6	352,5	208,6	440,5	87,6	38,8	56,2
15-35	643,0	604,6	474,6	388,3	41,2	165,9	88,8
36-60	26,3	28,2	20,0	20,0	8,2	6,3	0,0
61-90	58,3	41,4	12,8	28,7	8,6	9,7	20,0
91-180	122,4	335,0	279,0	10,9	26,0	81,6	30,0
>180	70,1	103,6	61,5	8,9	2,1	21,2	40,0
<b>Total</b>	<b>1455,7</b>	<b>1465,3</b>	<b>1056,5</b>	<b>897,2</b>	<b>173,8</b>	<b>323,4</b>	<b>235,0</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	5.27%		4.56%	4.78%	4.74%
15-35	5.27%		5.31%	5.29%	5.30%
36-60	—		5.38%	5.10%	5.17%
61-90	5.07%		5.20%	4.86%	5.05%
91-180	4.84%		4.85%	4.54%	4.78%
>180	4.76%		4.73%	4.66%	4.73%
<b>Total</b>	<b>5.11%</b>		<b>4.99%</b>	<b>5.00%</b>	<b>5.01%</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	16	38	1099	964	116	245	7934	10129	33	91	6654	7654
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	521	625	0	0	5604	3585	0	0	4890	3467
Otros <sup>c</sup>	38	16	63	93	245	116	1483	1270	91	33	747	1125
<b>Total</b>	<b>54</b>	<b>54</b>	<b>1683</b>	<b>1682</b>	<b>361</b>	<b>361</b>	<b>15021</b>	<b>14984</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>12291</b>	<b>12246</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