

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 28 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\$4449 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.79%<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	757,4	380,4	299,8	563,3	15,5	129,1	65
15-35	1209,2	1962,5	653,9	210,2	494,6	185,0	814
36-60	63,6	182,4	40,7	1,3	115,6	36,3	26
61-90	121,1	4,4	1,5	0,0	2,8	121,1	0
91-180	372,7	113,6	66,0	2,2	22,6	345,5	25
>180	149,1	163,3	62,4	41,9	0,8	7,1	100
<b>Total</b>	<b>2673,0</b>	<b>2806,5</b>	<b>1124,4</b>	<b>818,9</b>	<b>652,0</b>	<b>824,1</b>	<b>1030</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	5.07%	5.28%	4.12%	4.37%
15-35	5.12%	4.73%	5.09%	4.92%
36-60	5.03%	4.92%	4.99%	4.95%
61-90	—	4.99%	4.84%	4.84%
91-180	4.84%	5.15%	4.58%	4.63%
>180	4.79%	4.69%	4.61%	4.76%
<b>Total</b>	<b>5.08%</b>	<b>4.79%</b>	<b>4.55%</b>	<b>4.79%</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	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	111	247	8625	10405	41	97	6761	7794	87	91	7213	7534
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5808	4101	0	0	4997	3541	0	0	4212	3304
Otros <sup>c</sup>	247	111	1489	1380	97	41	749	1127	91	87	1088	1644
<b>Total</b>	<b>358</b>	<b>358</b>	<b>15922</b>	<b>15886</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>12507</b>	<b>12462</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>12513</b>	<b>12482</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