

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2024**  
**Fecha de Información: 29 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\$3811 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.63%<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	651,7	322,9	239,7	589,3	40,2	19,5	43,0
15-35	1181,6	1148,0	738,5	833,0	182,0	121,1	227,5
36-60	33,9	120,2	95,5	0,0	22,7	0,0	33,9
61-90	15,5	101,3	90,0	0,0	11,1	15,3	0,2
91-180	167,6	279,4	235,1	91,9	29,3	0,0	75,7
>180	58,1	116,4	84,8	28,6	26,6	24,5	5,0
<b>Total</b>	<b>2108,3</b>	<b>2088,2</b>	<b>1483,7</b>	<b>1542,8</b>	<b>311,8</b>	<b>180,3</b>	<b>385,2</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	5.07%	4.98%	4.14%	4.40%
15-35	5.04%	4.55%	4.84%	4.70%
36-60	5.08%	5.04%	4.96%	5.00%
61-90	4.70%	5.04%	4.65%	4.81%
91-180	4.68%	4.74%	4.61%	4.70%
>180	4.68%	4.80%	4.57%	4.70%
<b>Total</b>	<b>5.02%</b>	<b>4.65%</b>	<b>4.50%</b>	<b>4.63%</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	105	150	8463	9934	46	99	6774	7831	92	91	7486	7727
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5556	4130	0	0	5028	3546	0	0	4248	3564
Otros <sup>c</sup>	150	105	1402	1330	99	46	749	1129	91	92	1244	1657
<b>Total</b>	<b>255</b>	<b>255</b>	<b>15421</b>	<b>15394</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>12551</b>	<b>12506</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>12978</b>	<b>12948</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