

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de noviembre de 2024**  
**Fecha de Información: 06 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\$2702 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.05%<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	584,7	414,8	238,2	413,0	27,6	22,7	149
15-35	760,0	939,5	565,7	378,9	35,8	43,1	338
36-60	19,9	98,9	62,0	0,0	32,0	14,9	5
61-90	14,1	8,3	0,0	0,0	8,3	14,1	0
91-180	100,2	106,9	50,0	16,2	20,9	48,0	36
>180	151,4	46,0	30,8	117,4	0,2	19,0	15
<b>Total</b>	<b>1630,2</b>	<b>1614,4</b>	<b>946,6</b>	<b>925,5</b>	<b>124,8</b>	<b>161,7</b>	<b>543</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	5.18%	5.29%	5.18%	5.21%
15-35	5.27%	5.16%	4.70%	5.07%
36-60	4.93%	5.44%	4.71%	5.18%
61-90	—	4.88%	4.49%	4.63%
91-180	4.86%	4.25%	4.66%	4.52%
>180	4.66%	4.68%	4.69%	4.68%
<b>Total</b>	<b>5.20%</b>	<b>5.11%</b>	<b>4.89%</b>	<b>5.05%</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	04 – 08 nov.				11 - 15 nov.				18 - 22 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	49	98	7449	7707	132	107	8561	8984	89	106	8414	9350
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4972	4298	0	0	4605	3996	0	0	5496	3509
Otros <sup>c</sup>	98	49	445	810	107	132	1557	1710	106	89	759	1796
<b>Total</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>12866</b>	<b>12815</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>14723</b>	<b>14690</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>14669</b>	<b>14655</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