

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de noviembre de 2024**  
**Fecha de Información: 07 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\$3647 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.56%<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	824,5	391,9	209,1	637,0	30,8	35,5	152,0
15-35	1328,6	1001,0	601,0	922,2	57,5	63,9	342,5
36-60	28,3	34,4	3,4	10,0	31,0	18,3	0,0
61-90	65,4	127,6	114,0	0,0	13,6	65,4	0,0
91-180	73,0	20,4	0,6	19,4	14,8	48,7	5,0
>180	138,4	143,1	105,3	103,0	7,8	5,4	30,0
<b>Total</b>	<b>2458,3</b>	<b>1718,3</b>	<b>1033,4</b>	<b>1691,6</b>	<b>155,4</b>	<b>237,1</b>	<b>529,5</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%		5.25%	4.39%	4.79%
15-35	5.10%		4.50%	4.18%	4.47%
36-60	—		5.30%	4.90%	5.15%
61-90	—		4.82%	4.73%	4.76%
91-180	4.76%		4.65%	4.62%	4.64%
>180	4.68%		4.21%	3.10%	4.10%
<b>Total</b>	<b>5.07%</b>		<b>4.65%</b>	<b>4.26%</b>	<b>4.56%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{365/\text{Plazo}}}) - 1$ . 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	36	54	5527	5610	136	120	8897	9078	99	110	8779	9585
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3682	3250	0	0	4678	4321	0	0	5623	3759
Otros <sup>c</sup>	54	36	68	353	120	136	1567	1710	110	99	772	1816
<b>Total</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>9277</b>	<b>9213</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>15142</b>	<b>15109</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>15174</b>	<b>15160</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