

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 02 de septiembre 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\$411 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.00%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	73,8	52,6	23,0	47,4	4,4	1,2	25,2
15-35	71,0	51,0	36,5	48,5	1,5	9,5	13,0
36-60	1,1	3,8	3,1	0,0	0,7	1,1	0,0
61-90	3,3	1,3	0,0	0,0	1,3	3,3	0,0
91-180	4,6	4,5	3,7	3,3	0,9	1,3	0,0
>180	80,2	102,3	102,3	79,4	0,1	0,8	0,0
<b>Total</b>	<b>233,9</b>	<b>215,6</b>	<b>168,6</b>	<b>178,6</b>	<b>8,9</b>	<b>17,1</b>	<b>38,2</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	4.41%	5.35%	4.74%	4.58%
15-35	5.09%	5.30%	4.94%	5.08%
36-60	–	5.41%	4.97%	5.15%
61-90	–	11.23%	4.87%	6.73%
91-180	–	4.47%	4.45%	4.46%
>180	–	5.37%	4.69%	4.73%
<b>Total</b>	<b>4.64%</b>	<b>5.49%</b>	<b>4.91%</b>	<b>5.00%</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	02 – 06 sept.				09 - 13 sept.				16 - 20 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	85	105	8140	8457	95	119	8472	9137	37	116	7221	7263
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4449	3619	0	0	5370	3068	0	0	4464	2966
Otros <sup>c</sup>	105	85	742	1225	119	95	396	1992	116	37	569	2013
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>13331</b>	<b>13301</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>14238</b>	<b>14197</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>12254</b>	<b>12242</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