

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 04 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\$3566 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.11%<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	556,6	582,1	283,9	380,8	161,9	39,4	136,4
15-35	694,3	967,0	688,4	281,0	25,0	159,8	253,5
36-60	267,4	304,0	156,7	95,3	6,6	31,4	140,7
61-90	49,8	68,4	0,0	28,9	68,4	20,9	0,0
91-180	237,2	39,3	10,2	201,4	4,0	10,8	25,0
>180	128,8	297,0	226,2	44,5	0,8	14,3	70,0
<b>Total</b>	<b>1934,1</b>	<b>2257,8</b>	<b>1365,4</b>	<b>1031,8</b>	<b>266,7</b>	<b>276,6</b>	<b>625,6</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	5.28%	4.93%	4.59%	4.86%
15-35	5.28%	5.32%	5.19%	5.27%
36-60	5.23%	5.24%	5.11%	5.22%
61-90	–	5.23%	5.10%	5.20%
91-180	5.10%	4.96%	4.74%	4.99%
>180	5.02%	5.05%	4.91%	5.02%
<b>Total</b>	<b>5.23%</b>	<b>5.17%</b>	<b>4.91%</b>	<b>5.11%</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	73	71	5901	5918	99	130	8978	9877	40	117	7412	7451
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3342	3010	0	0	5692	3302	0	0	4571	3051
Otros <sup>c</sup>	71	73	282	568	130	99	590	2037	117	40	585	2054
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>9525</b>	<b>9496</b>	<b>229</b>	<b>229</b>	<b>15260</b>	<b>15216</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>12568</b>	<b>12556</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