

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 06 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\$3550 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.10%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	597,8	728,9	335,3	240,9	139,1	102,4	254,5
15-35	862,9	863,1	305,8	285,0	19,9	40,4	537,4
36-60	57,1	42,2	12,3	0,0	17,9	45,1	12,0
61-90	69,0	129,2	110,7	0,0	18,5	69,0	0,0
91-180	147,4	53,3	30,2	135,8	18,2	6,6	5,0
>180	749,2	756,3	58,0	48,3	0,3	2,9	698,0
<b>Total</b>	<b>2483,4</b>	<b>2573,0</b>	<b>852,2</b>	<b>710,1</b>	<b>213,8</b>	<b>266,5</b>	<b>1506,9</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	5.23%	5.23%	4.32%	4.99%
15-35	5.19%	5.26%	5.19%	5.20%
36-60	5.13%	5.41%	5.10%	5.21%
61-90	–	5.21%	5.20%	5.20%
91-180	5.10%	5.28%	4.82%	5.15%
>180	5.06%	5.08%	4.84%	5.06%
<b>Total</b>	<b>5.14%</b>	<b>5.25%</b>	<b>4.86%</b>	<b>5.10%</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>

Sector	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	26	22	401	459	129	131	9821	10535	45	118	7688	8263
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	291	202	0	0	6000	3915	0	0	5192	3076
Otros <sup>c</sup>	22	26	42	72	131	129	737	2063	118	45	608	2134
<b>Total</b>	<b>48</b>	<b>48</b>	<b>734</b>	<b>733</b>	<b>260</b>	<b>260</b>	<b>16558</b>	<b>16513</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>13488</b>	<b>13473</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