

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 09 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\$4074 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.93%<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	510,2	676,3	370,7	431,6	305,6	78,5	0,0
15-35	759,6	1141,9	867,3	399,6	9,6	95,0	265,0
36-60	275,0	358,2	240,1	100,0	8,0	65,0	110,0
61-90	24,7	4,1	0,0	15,0	4,1	9,7	0,0
91-180	438,8	161,2	103,9	118,8	9,2	272,0	48,1
>180	128,3	30,8	18,6	42,5	0,6	74,3	11,5
<b>Total</b>	<b>2136,5</b>	<b>2372,4</b>	<b>1600,7</b>	<b>1107,5</b>	<b>337,1</b>	<b>594,4</b>	<b>434,6</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	–	4.63%	4.59%	4.61%
15-35	5.22%	5.12%	4.75%	5.05%
36-60	5.37%	5.43%	4.98%	5.32%
61-90	–	5.29%	5.03%	5.11%
91-180	5.00%	5.05%	4.95%	4.98%
>180	4.91%	5.30%	4.74%	4.77%
<b>Total</b>	<b>5.22%</b>	<b>4.98%</b>	<b>4.76%</b>	<b>4.93%</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	09 – 13 sept.				16 - 20 sept.				23 - 27 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	140	132	10223	10925	57	120	7824	8485	25	263	5833	6068
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	6103	4267	0	0	5373	3129	0	0	3740	2465
Otros <sup>c</sup>	132	140	984	2072	120	57	609	2177	263	25	760	1798
<b>Total</b>	<b>272</b>	<b>272</b>	<b>17310</b>	<b>17264</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>13806</b>	<b>13791</b>	<b>288</b>	<b>288</b>	<b>10333</b>	<b>10331</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