

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 10 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\$5559 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.03%<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	833,6	566,8	475,4	705,3	8,0	45,0	83,3
15-35	1085,8	1061,8	689,8	538,0	28,5	204,3	343,5
36-60	266,8	382,8	246,8	104,3	15,9	42,4	120,0
61-90	72,3	337,1	327,3	61,8	8,8	9,5	1,0
91-180	123,4	456,8	402,8	47,0	12,7	35,1	41,3
>180	417,5	593,9	215,0	348,1	328,8	19,5	50,0
<b>Total</b>	<b>2799,4</b>	<b>3399,1</b>	<b>2357,1</b>	<b>1804,4</b>	<b>402,8</b>	<b>355,9</b>	<b>639,1</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	5.24%	4.90%	3.87%	4.30%
15-35	5.29%	5.35%	5.16%	5.27%
36-60	5.09%	5.19%	5.04%	5.10%
61-90	4.87%	5.14%	4.80%	5.13%
91-180	5.08%	5.07%	4.93%	5.06%
>180	4.91%	5.24%	4.95%	5.10%
<b>Total</b>	<b>5.20%</b>	<b>5.19%</b>	<b>4.70%</b>	<b>5.03%</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	133	111	9124	9992	64	123	8150	8751	29	263	5836	6118
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5566	4127	0	0	5606	3398	0	0	3756	2465
Otros <sup>c</sup>	111	133	1274	1812	123	64	612	2204	263	29	794	1801
<b>Total</b>	<b>244</b>	<b>244</b>	<b>15964</b>	<b>15931</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>14368</b>	<b>14353</b>	<b>292</b>	<b>292</b>	<b>10386</b>	<b>10384</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