

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 11 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\$4821 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.68%<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         | 738,9                          | 948,9         | 402,6                               | 628,1         | 475,3         | 39,8         | 71,0                                 |
| 15-35        | 967,9                          | 806,3         | 581,0                               | 749,0         | 55,8          | 49,4         | 169,5                                |
| 36-60        | 126,3                          | 379,4         | 355,2                               | 70,0          | 3,6           | 35,7         | 20,5                                 |
| 61-90        | 373,0                          | 23,7          | 0,5                                 | 0,0           | 23,2          | 373,0        | 0,0                                  |
| 91-180       | 272,2                          | 475,5         | 335,7                               | 47,8          | 31,4          | 115,9        | 108,5                                |
| >180         | 40,8                           | 43,1          | 27,0                                | 9,4           | 11,0          | 26,4         | 5,0                                  |
| <b>Total</b> | <b>2518,9</b>                  | <b>2676,9</b> | <b>1702,1</b>                       | <b>1504,2</b> | <b>600,3</b>  | <b>640,2</b> | <b>374,6</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         | 5.24%   | 4.41%                        | 4.43%        | 4.46%        |
| 15-35        | 5.25%   | 5.10%                        | 4.30%        | 4.75%        |
| 36-60        | 5.05%   | 4.31%                        | 4.99%        | 4.44%        |
| 61-90        | –   | 5.16%                        | 5.15%        | 5.15%        |
| 91-180       | 5.05%   | 4.76%                        | 4.94%        | 4.88%        |
| >180         | 4.96%   | 5.13%                        | 4.74%        | 4.87%        |
| <b>Total</b> | <b>5.17%</b>                                      | <b>4.66%</b>                 | <b>4.59%</b> | <b>4.68%</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                   | 119           | 91         | 7362         | 7825         | 66            | 126        | 8660         | 9528         | 31            | 265        | 5888         | 6175         |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0             | 0          | 4806         | 3514         | 0             | 0          | 5879         | 3853         | 0             | 0          | 3806         | 2503         |
| Otros <sup>c</sup>                  | 91            | 119        | 592          | 1403         | 126           | 66         | 1082         | 2226         | 265           | 31         | 801          | 1816         |
| <b>Total</b>                        | <b>210</b>    | <b>210</b> | <b>12760</b> | <b>12742</b> | <b>192</b>    | <b>192</b> | <b>15621</b> | <b>15607</b> | <b>296</b>    | <b>296</b> | <b>10495</b> | <b>10494</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