

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 18 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\$5233 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.51%<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	1432,9	914,1	411,9	1126,3	223,2	27,6	279,0
15-35	829,5	1612,2	1262,4	488,2	23,7	15,2	326,2
36-60	159,2	113,4	40,0	115,0	33,4	4,2	40,0
61-90	102,9	192,4	107,4	0,0	18,0	35,9	67,0
91-180	314,8	77,1	10,0	45,6	25,1	227,3	42,0
>180	132,4	116,6	98,4	102,7	8,2	19,7	10,0
<b>Total</b>	<b>2971,7</b>	<b>3025,8</b>	<b>1930,0</b>	<b>1877,7</b>	<b>331,6</b>	<b>329,8</b>	<b>764,2</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	5.07%	2.66%	3.98%	3.89%
15-35	5.10%	4.78%	4.91%	4.86%
36-60	4.82%	5.08%	4.73%	4.98%
61-90	4.88%	4.96%	4.88%	4.91%
91-180	4.91%	5.05%	4.74%	4.79%
>180	4.92%	4.90%	4.87%	4.89%
<b>Total</b>	<b>5.04%</b>	<b>4.41%</b>	<b>4.36%</b>	<b>4.51%</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	16 – 20 sept.				23 - 27 sept.				30 sept. - 04 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	46	106	5124	5617	50	266	7304	7610	43	129	5946	6916
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3467	2791	0	0	4366	3283	0	0	4171	2084
Otros <sup>c</sup>	106	46	826	996	266	50	1221	1991	129	43	331	1446
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>9417</b>	<b>9404</b>	<b>316</b>	<b>316</b>	<b>12891</b>	<b>12884</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>10448</b>	<b>10446</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