

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 02 de septiembre de 2024**

**Fecha de Información: 29 de agosto 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\$3562 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.37%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	623,2	575,5	396,9	433,7	28,6	39,4	150,0
15-35	846,2	1017,1	630,2	464,8	111,9	106,4	275,0
36-60	96,4	204,3	129,0	0,0	2,8	23,9	72,5
61-90	35,8	44,8	28,0	0,0	15,7	34,8	1,0
91-180	223,6	129,6	87,5	138,7	17,0	60,0	25,0
>180	156,8	146,2	116,6	114,0	15,2	28,4	14,4
<b>Total</b>	<b>1982,0</b>	<b>2117,4</b>	<b>1388,3</b>	<b>1151,1</b>	<b>191,2</b>	<b>293,0</b>	<b>537,9</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		
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	5.08%	4.66%	4.45%	4.64%
15-35	5.05%	7.91%	4.33%	6.13%
36-60	5.05%	3.89%	4.44%	4.31%
61-90	5.03%	5.26%	4.89%	5.00%
91-180	5.11%	5.14%	4.94%	5.05%
>180	5.05%	5.08%	4.81%	4.95%
<b>Total</b>	<b>5.06%</b>	<b>6.31%</b>	<b>4.46%</b>	<b>5.37%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards<sup>a</sup>

Sectores	26 – 30 ago.				02 - 06 sept.				09 - 13 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	34	105	4394	4465	75	93	7817	8211	76	119	8269	8979
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2137	2110	0	0	4266	3363	0	0	5243	2931
Otros <sup>c</sup>	105	34	516	471	93	75	742	1222	119	76	393	1953
<b>Total</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>7047</b>	<b>7046</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>12825</b>	<b>12796</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>13905</b>	<b>13863</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