

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 09 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 05 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\$3539 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.06%<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	758,5	837,1	584,6	522,2	39,1	23,0	213,4
15-35	773,2	1005,6	458,4	109,6	10,8	127,2	536,4
36-60	138,4	146,8	60,0	82,7	36,8	5,7	50,0
61-90	52,6	82,9	47,7	0,0	10,8	28,3	24,3
91-180	393,8	58,2	0,0	285,7	8,2	58,1	50,0
>180	91,9	129,2	73,8	34,1	0,4	2,8	55,0
<b>Total</b>	<b>2208,5</b>	<b>2259,8</b>	<b>1224,6</b>	<b>1034,3</b>	<b>106,1</b>	<b>245,1</b>	<b>929,1</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.17%		4.86%	4.77%	4.90%
15-35	5.22%		5.22%	5.08%	5.20%
36-60	5.01%		5.09%	4.75%	5.05%
61-90	5.11%		5.30%	5.04%	5.12%
91-180	5.09%		5.06%	5.01%	5.04%
>180	5.08%		5.17%	4.97%	5.08%
<b>Total</b>	<b>5.18%</b>		<b>5.06%</b>	<b>4.89%</b>	<b>5.06%</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	02 – 06 sept.				09 - 13 sept.				16 - 20 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	43	51	3833	4022	102	128	9391	10073	43	118	7454	7900
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2356	2033	0	0	5736	3580	0	0	5016	3076
Otros <sup>c</sup>	51	43	98	216	128	102	621	2052	118	43	589	2071
<b>Total</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>6287</b>	<b>6271</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>15748</b>	<b>15705</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>13059</b>	<b>13047</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