

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2024**  
**Fecha de Información: 12 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\$4586 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.71%<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	878,0	657,0	438,0	831,6	184,0	11,4	35,0
15-35	1008,8	992,2	705,3	547,1	20,4	195,3	266,5
36-60	120,2	53,0	42,0	117,0	9,9	2,1	1,1
61-90	114,5	354,6	251,4	0,0	49,7	61,0	53,5
91-180	103,1	349,6	297,8	7,8	21,8	65,4	30,0
>180	130,1	255,8	209,9	79,9	0,8	5,1	45,0
<b>Total</b>	<b>2354,7</b>	<b>2662,3</b>	<b>1944,4</b>	<b>1583,4</b>	<b>286,8</b>	<b>340,3</b>	<b>431,1</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	5.30%	4.29%	3.90%	4.10%
15-35	5.32%	5.38%	4.77%	5.11%
36-60	5.18%	5.05%	4.79%	5.04%
61-90	5.01%	4.60%	4.96%	4.72%
91-180	5.09%	5.00%	4.92%	4.99%
>180	4.93%	4.98%	4.83%	4.95%
<b>Total</b>	<b>5.22%</b>	<b>4.86%</b>	<b>4.37%</b>	<b>4.71%</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	56	64	5183	5517	70	127	9078	9931	32	266	5900	6209
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3307	2585	0	0	6083	4245	0	0	3831	2507
Otros <sup>c</sup>	64	56	493	877	127	70	1255	2225	266	32	809	1823
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>8983</b>	<b>8979</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>16416</b>	<b>16401</b>	<b>298</b>	<b>298</b>	<b>10540</b>	<b>10539</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