

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de agosto de 2024**  
**Fecha de Información: 05 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\$3213 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.85%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>3</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>2</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>3</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	495,1	736,7	112,4	191,3	359,3	38,8	265,0
15-35	509,7	906,3	570,2	150,1	17,5	41,0	318,6
36-60	482,0	192,1	126,0	6,8	5,1	414,2	61,0
61-90	88,4	3,1	0,0	3,6	1,2	82,8	1,9
91-180	112,9	89,1	62,7	4,1	11,4	93,8	15,0
>180	111,8	147,7	137,9	82,4	9,8	29,3	0,0
<b>Total</b>	<b>1799,9</b>	<b>2075,0</b>	<b>1009,2</b>	<b>438,4</b>	<b>404,3</b>	<b>700,0</b>	<b>661,5</b>

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario <sup>1</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.01%		5.98%	5.88%	5.98%
15-35	5.99%		5.92%	5.53%	5.88%
36-60	5.84%		5.63%	5.88%	5.83%
61-90	5.63%		5.55%	5.53%	5.53%
91-180	5.69%		5.75%	5.44%	5.50%
>180	—		5.42%	5.07%	5.31%
<b>Total</b>	<b>5.98%</b>		<b>5.88%</b>	<b>5.71%</b>	<b>5.85%</b>

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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado)  $^{\wedge}$  (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

<sup>3</sup>Cifras en millones de dólares

<sup>2</sup>Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>3</sup>Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

<sup>1</sup>Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	05 - 09 ago.				12 - 16 ago.				19 - 23 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	516	118	7540	8477	81	152	8563	9640	30	135	6492	6586
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4928	3690	0	0	5417	2817	0	0	3541	2118
Otros <sup>c</sup>	118	516	344	589	152	81	1103	2568	135	30	631	1932
<b>Total</b>	<b>634</b>	<b>634</b>	<b>12812</b>	<b>12756</b>	<b>233</b>	<b>233</b>	<b>15083</b>	<b>15025</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>10664</b>	<b>10636</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