

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 09 de agosto de 2024**  
**Fecha de Información: 06 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\$5534 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.78%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1933,3	1653,7	274,3	775,5	239,8	18,1	1139,6
15-35	809,8	1129,2	706,0	239,0	32,0	179,6	391,2
36-60	256,1	24,0	1,2	0,0	11,8	245,1	11,0
61-90	531,9	819,8	304,8	13,8	9,9	13,1	505,1
91-180	135,7	74,2	52,3	0,0	1,9	115,7	20,0
>180	126,3	167,4	106,9	55,7	0,5	10,6	60,0
<b>Total</b>	<b>3793,1</b>	<b>3868,3</b>	<b>1445,5</b>	<b>1084,0</b>	<b>295,9</b>	<b>582,2</b>	<b>2126,9</b>

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario <sup>1</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.84%	5.79%	5.52%	5.75%
15-35	5.92%	5.95%	5.86%	5.92%
36-60	5.90%	6.05%	5.88%	5.89%
61-90	5.67%	5.84%	5.42%	5.67%
91-180	5.67%	5.68%	5.53%	5.58%
>180	5.35%	5.47%	5.08%	5.38%
<b>Total</b>	<b>5.80%</b>	<b>5.86%</b>	<b>5.67%</b>	<b>5.78%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ {(365/\text{Plazo}))} - 1$ . 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>	426	108	6032	6571	84	155	10239	11134	31	137	6515	6755
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3951	3155	0	0	5598	3400	0	0	3675	2118
Otros <sup>c</sup>	108	426	305	512	155	84	1339	2585	137	31	647	1935
<b>Total</b>	<b>534</b>	<b>534</b>	<b>10288</b>	<b>10238</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>17176</b>	<b>17119</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>10837</b>	<b>10808</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