

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2024**  
**Fecha de Información: 08 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\$4311 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.63%<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	1559,8	1147,4	390,2	815,4	33,0	20,3	724,1
15-35	826,9	1086,9	718,5	280,0	36,4	214,9	332,0
36-60	40,7	23,0	0,0	30,0	23,0	10,7	0,0
61-90	205,4	208,2	117,5	123,6	19,9	11,1	70,8
91-180	47,7	119,9	100,8	30,0	19,1	17,7	0,0
>180	89,4	107,7	80,7	43,6	2,0	20,8	25,0
<b>Total</b>	<b>2770,1</b>	<b>2693,1</b>	<b>1407,7</b>	<b>1322,6</b>	<b>133,4</b>	<b>295,6</b>	<b>1151,9</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	5.85%		5.36%	4.50%	5.41%
15-35	5.84%		5.97%	5.75%	5.87%
36-60	—		5.98%	5.81%	5.87%
61-90	5.73%		5.77%	5.45%	5.73%
91-180	—		5.49%	5.48%	5.49%
>180	5.27%		5.87%	4.98%	5.17%
<b>Total</b>	<b>5.83%</b>		<b>5.74%</b>	<b>5.21%</b>	<b>5.63%</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) ^ (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>	324	78	4687	5100	87	157	11281	12011	33	137	6706	6905
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3039	2435	0	0	5925	3892	0	0	3759	2235
Otros <sup>c</sup>	78	324	251	392	157	87	1345	2591	137	33	672	1968
<b>Total</b>	<b>402</b>	<b>402</b>	<b>7977</b>	<b>7927</b>	<b>244</b>	<b>244</b>	<b>18551</b>	<b>18494</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>11137</b>	<b>11108</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