

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 21 de agosto de 2024**  
**Fecha de Información: 16 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\$3089 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.25%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero <sup>a</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>b</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	774,5	534,5	54,5	448,9	195,0	40,7	285,0
15-35	912,7	946,7	555,5	337,8	39,7	223,4	351,5
36-60	24,2	33,3	10,0	0,0	13,3	14,2	10,0
61-90	14,8	58,3	51,7	0,0	6,6	14,8	0,0
91-180	205,0	223,2	150,2	35,9	43,0	139,1	30,0
>180	27,1	26,1	4,8	11,5	6,3	0,6	15,0
<b>Total</b>	<b>1958,3</b>	<b>1822,2</b>	<b>826,7</b>	<b>834,2</b>	<b>303,9</b>	<b>432,7</b>	<b>691,5</b>

Nota: Cifras en millones de dólares.

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

<sup>b</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	5.72%	3.36%	4.89%	4.73%
15-35	5.65%	5.49%	5.51%	5.54%
36-60	5.57%	5.73%	5.50%	5.63%
61-90	—	5.64%	5.36%	5.57%
91-180	5.40%	5.45%	5.22%	5.35%
>180	5.16%	5.52%	5.17%	5.26%
<b>Total</b>	<b>5.66%</b>	<b>4.93%</b>	<b>5.27%</b>	<b>5.25%</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

Sectores	12 – 16 ago.				19 - 23 ago.				26 - 30 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	13	44	942	1197	50	171	8743	8884	50	205	7408	8272
Intragrupo y off-shore <sup>a</sup>	0	0	543	378	0	0	4193	3561	0	0	4397	2960
Otros <sup>b</sup>	44	13	172	71	171	50	1673	2136	205	50	700	1266
<b>Total</b>	<b>57</b>	<b>57</b>	<b>1657</b>	<b>1646</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>14609</b>	<b>14581</b>	<b>255</b>	<b>255</b>	<b>12505</b>	<b>12498</b>

Nota: Cifras en millones de dólares.

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

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes