

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de agosto de 2024**  
**Fecha de Información: 13 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\$4448 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.41%<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	1001,7	1156,1	281,0	568,1	457,5	16,0	417,6
15-35	969,1	1304,6	522,1	234,0	83,0	35,6	699,5
36-60	283,6	103,0	51,2	75,5	51,9	208,1	0,0
61-90	4,5	13,4	0,0	0,0	12,2	3,4	1,1
91-180	332,0	134,7	80,0	0,2	27,2	304,3	27,5
>180	152,8	168,3	128,9	67,9	9,4	54,9	30,0
<b>Total</b>	<b>2743,7</b>	<b>2880,1</b>	<b>1063,1</b>	<b>945,7</b>	<b>641,2</b>	<b>622,3</b>	<b>1175,8</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	5.73%	4.35%	5.83%	5.15%
15-35	5.70%	5.69%	5.36%	5.65%
36-60	–	5.27%	5.61%	5.52%
61-90	5.42%	5.66%	5.36%	5.58%
91-180	5.45%	5.24%	5.37%	5.37%
>180	5.15%	5.31%	5.24%	5.23%
<b>Total</b>	<b>5.69%</b>	<b>5.02%</b>	<b>5.55%</b>	<b>5.41%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . 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	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 <sup>a</sup>	89	127	10691	11222	42	146	7455	7897	40	198	6915	7728
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5586	4059	0	0	4026	2618	0	0	4177	2743
Otros <sup>c</sup>	127	89	1126	2070	146	42	1069	2005	198	40	623	1237
<b>Total</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>17403</b>	<b>17351</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>12550</b>	<b>12520</b>	<b>238</b>	<b>238</b>	<b>11715</b>	<b>11708</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