

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2024**  
**Fecha de Información: 27 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\$2504 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.15%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	537,3	455,3	173,0	332,5	100,4	22,9	181,9
15-35	620,2	614,0	312,2	308,4	20,8	30,9	281,0
36-60	59,9	159,9	125,5	0,0	19,4	44,9	15,0
61-90	2,9	6,8	0,0	0,0	5,8	2,0	1,0
91-180	275,1	104,9	1,0	72,5	20,9	119,6	83,0
>180	58,8	199,4	160,2	24,6	10,2	5,2	29,0
<b>Total</b>	<b>1554,3</b>	<b>1540,3</b>	<b>772,0</b>	<b>738,0</b>	<b>177,6</b>	<b>225,5</b>	<b>590,8</b>

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

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

<sup>c</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	5.06%	4.96%	5.19%	5.07%
15-35	5.23%	5.25%	5.09%	5.18%
36-60	5.26%	5.30%	5.24%	5.28%
61-90	5.10%	5.66%	4.66%	5.37%
91-180	5.15%	5.41%	5.12%	5.16%
>180	5.04%	5.09%	4.93%	5.07%
<b>Total</b>	<b>5.16%</b>	<b>5.15%</b>	<b>5.13%</b>	<b>5.15%</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<sup>a</sup>

Sectores	26 – 30 ago.				02 - 06 sept.				09 - 13 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero	45	171	9096	9554	64	91	7121	7794	58	113	7710	8728
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4835	4323	0	0	3980	2819	0	0	5164	2594
Otros <sup>c</sup>	171	45	1098	1149	91	64	741	1200	113	58	362	1879
<b>Total</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>15029</b>	<b>15026</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>11842</b>	<b>11813</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>13236</b>	<b>13201</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