

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2024**  
**Fecha de Información: 14 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\$5011 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.37%<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	1069,0	691,2	125,4	882,8	465,8	86,2	100,0
15-35	919,8	994,6	770,9	527,8	45,7	214,0	178,0
36-60	349,8	176,0	0,4	183,3	32,6	23,5	143,0
61-90	0,5	206,2	160,0	0,0	46,2	0,5	0,0
91-180	345,8	512,1	343,9	0,0	113,2	290,8	55,0
>180	110,7	136,6	110,6	79,4	0,6	5,9	25,4
<b>Total</b>	<b>2795,6</b>	<b>2716,8</b>	<b>1511,2</b>	<b>1673,3</b>	<b>704,1</b>	<b>620,9</b>	<b>501,4</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	5.59%		5.22%	5.13%	5.20%
15-35	5.61%		5.51%	5.59%	5.55%
36-60	5.45%		5.87%	5.37%	5.51%
61-90	—		5.74%	5.44%	5.73%
91-180	5.41%		5.43%	5.25%	5.33%
>180	5.14%		5.33%	5.15%	5.21%
<b>Total</b>	<b>5.51%</b>		<b>5.41%</b>	<b>5.29%</b>	<b>5.37%</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)  $^{\wedge}$  (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	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>	68	110	8946	9271	43	150	7854	8340	40	203	7122	7896
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4625	3590	0	0	4052	2937	0	0	4257	2903
Otros <sup>c</sup>	110	68	877	1551	150	43	1485	2085	203	40	671	1244
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>14448</b>	<b>14412</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>13391</b>	<b>13362</b>	<b>243</b>	<b>243</b>	<b>12050</b>	<b>12043</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