

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de junio de 2024**  
**Fecha de Información: 07 de junio 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\$3272 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.01%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	692,7	699,4	270,5	287,7	46,2	22,4	382,6
15-35	942,1	1238,4	528,8	301,9	120,6	51,2	589,0
36-60	108,2	274,9	190,0	0,0	14,9	38,2	70,0
61-90	57,3	55,2	32,5	34,7	12,7	12,6	10,0
91-180	62,5	96,6	50,3	0,0	36,3	52,5	10,0
>180	55,1	51,2	49,3	52,2	2,0	2,9	0,0
<b>Total</b>	<b>1918,0</b>	<b>2415,6</b>	<b>1121,3</b>	<b>676,6</b>	<b>232,7</b>	<b>179,8</b>	<b>1061,6</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	6.42%	5.23%	6.32%	6.17%
15-35	6.35%	6.13%	6.15%	6.23%
36-60	6.29%	4.10%	6.09%	4.84%
61-90	5.99%	6.10%	5.71%	6.01%
91-180	5.67%	5.69%	5.50%	5.61%
>180	–	4.71%	5.18%	4.99%
<b>Total</b>	<b>6.36%</b>	<b>5.60%</b>	<b>6.15%</b>	<b>6.01%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	03 - 07 jun.				10 - 14 jun.				17 - 21 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	12	57	1103	1311	85	156	8233	9033	140	150	7801	8218
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	803	546	0	0	5095	3879	0	0	5059	4070
Otros <sup>c</sup>	57	12	45	94	156	85	956	1364	150	140	604	1126
<b>Total</b>	<b>69</b>	<b>69</b>	<b>1951</b>	<b>1951</b>	<b>241</b>	<b>241</b>	<b>14284</b>	<b>14276</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>13464</b>	<b>13414</b>

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

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

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