

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 18 de junio de 2024**  
**Fecha de Información: 14 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\$2925 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.48%<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	384,6	666,4	428,6	158,5	64,7	53,1	173,0
15-35	658,8	663,5	519,8	477,5	63,6	101,4	80,0
36-60	144,5	223,9	110,0	1,6	33,9	62,9	80,0
61-90	25,5	100,5	88,1	0,0	12,4	25,5	0,0
91-180	101,4	51,6	28,5	73,1	23,1	28,3	0,0
>180	230,8	45,3	5,6	167,1	1,3	25,2	38,5
<b>Total</b>	<b>1545,7</b>	<b>1751,2</b>	<b>1180,7</b>	<b>877,8</b>	<b>199,0</b>	<b>296,4</b>	<b>371,5</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	6.96%	6.94%	6.38%	6.76%
15-35	6.75%	6.66%	6.72%	6.69%
36-60	6.53%	6.55%	6.36%	6.50%
61-90	–	6.36%	5.92%	6.17%
91-180	–	5.94%	5.82%	5.85%
>180	5.46%	5.78%	5.32%	5.35%
<b>Total</b>	<b>6.67%</b>	<b>6.66%</b>	<b>6.14%</b>	<b>6.48%</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	10 - 14 jun.				17 - 21 jun.				24 - 28 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	13	70	1992	2279	168	153	8597	9121	214	214	6921	7407
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1161	915	0	0	5744	4666	0	0	3606	2735
Otros <sup>c</sup>	70	13	242	193	153	168	672	1177	214	214	928	1279
<b>Total</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>3395</b>	<b>3387</b>	<b>321</b>	<b>321</b>	<b>15013</b>	<b>14964</b>	<b>428</b>	<b>428</b>	<b>11455</b>	<b>11421</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.