

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de junio de 2024**  
**Fecha de Información: 18 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\$3060 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.02%<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	556,0	433,6	164,1	328,0	65,7	24,2	203,8
15-35	797,5	883,0	475,2	385,1	70,0	74,6	337,9
36-60	172,5	305,6	250,0	51,6	10,6	75,9	45,0
61-90	52,4	82,0	47,7	2,4	34,0	49,7	0,3
91-180	107,9	78,1	36,5	13,5	26,6	79,4	15,0
>180	107,5	111,3	67,3	47,9	18,3	33,9	25,7
<b>Total</b>	<b>1793,8</b>	<b>1893,5</b>	<b>1040,7</b>	<b>828,5</b>	<b>225,1</b>	<b>337,6</b>	<b>627,7</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	6.51%	5.72%	6.52%	6.31%
15-35	6.58%	6.68%	5.10%	6.17%
36-60	6.09%	5.07%	6.13%	5.44%
61-90	5.96%	6.10%	5.92%	5.99%
91-180	5.80%	5.55%	5.66%	5.65%
>180	5.38%	5.51%	5.30%	5.39%
<b>Total</b>	<b>6.45%</b>	<b>6.03%</b>	<b>5.71%</b>	<b>6.02%</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	17 – 21 jun.				24 - 28 jun.				01 - 05 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	129	135	4911	5362	225	215	7209	7795	183	84	4016	6987
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3070	2337	0	0	3800	2829	0	0	4691	1408
Otros <sup>c</sup>	135	129	851	1117	215	225	949	1299	84	183	213	524
<b>Total</b>	<b>264</b>	<b>264</b>	<b>8832</b>	<b>8816</b>	<b>440</b>	<b>440</b>	<b>11958</b>	<b>11923</b>	<b>267</b>	<b>267</b>	<b>8920</b>	<b>8919</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.