

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de junio de 2024**  
**Fecha de Información: 24 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\$3186 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.44%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	559,3	551,9	331,4	335,5	15,0	18,3	205,5
15-35	763,8	603,1	286,5	479,7	66,4	33,8	250,3
36-60	62,1	194,3	161,0	0,0	13,3	42,1	20,0
61-90	81,2	97,8	40,7	40,0	17,1	1,2	40,0
91-180	354,4	343,6	10,0	15,6	23,6	28,7	310,0
>180	276,6	242,2	120,2	145,2	4,1	13,4	118,0
<b>Total</b>	<b>2097,3</b>	<b>2033,0</b>	<b>949,7</b>	<b>1016,0</b>	<b>139,5</b>	<b>137,5</b>	<b>943,8</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	7.15%	7.01%	6.46%	6.84%
15-35	6.72%	6.78%	6.52%	6.66%
36-60	6.24%	6.24%	6.35%	6.27%
61-90	5.26%	5.22%	5.83%	5.24%
91-180	5.79%	6.65%	5.73%	5.86%
>180	5.40%	5.62%	5.50%	5.42%
<b>Total</b>	<b>6.27%</b>	<b>6.66%</b>	<b>6.42%</b>	<b>6.44%</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	24 – 28 jun.				01 - 05 jul.				08 - 12 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	238	228	8371	8993	194	96	4676	7227	119	108	6694	8934
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4306	3421	0	0	4746	1869	0	0	5087	2384
Otros <sup>c</sup>	228	238	1226	1455	96	194	213	537	108	119	985	1371
<b>Total</b>	<b>466</b>	<b>466</b>	<b>13903</b>	<b>13869</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>9635</b>	<b>9633</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>12766</b>	<b>12689</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.