

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de julio de 2024**  
**Fecha de Información: 28 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\$2756 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.26%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	598,7	73,5	11,8	524,4	6,2	18,8	55,5
15-35	712,8	1061,1	758,8	275,8	59,8	194,4	242,5
36-60	8,9	97,0	70,0	0,0	27,0	8,9	0,0
61-90	48,2	145,5	39,1	41,9	106,4	6,2	0,0
91-180	4,2	108,8	96,6	0,0	11,7	3,8	0,5
>180	102,8	113,0	89,7	81,9	3,3	0,9	20,0
<b>Total</b>	<b>1475,5</b>	<b>1598,9</b>	<b>1066,1</b>	<b>924,0</b>	<b>214,4</b>	<b>233,0</b>	<b>318,5</b>

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario <sup>1</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	6.27%		5.60%	6.85%	6.75%
15-35	6.20%		6.22%	6.04%	6.17%
36-60	-		6.08%	5.68%	5.98%
61-90	-		5.92%	5.62%	5.90%
91-180	5.56%		5.84%	5.52%	5.75%
>180	5.43%		6.12%	5.29%	5.40%
<b>Total</b>	<b>6.16%</b>		<b>6.16%</b>	<b>6.40%</b>	<b>6.26%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ (365/\text{Plazo})) - 1$ . 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	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>	127	45	787	911	209	103	5919	7652	136	109	7471	9656
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	381	233	0	0	4770	2908	0	0	5476	2730
Otros <sup>c</sup>	45	127	224	248	103	209	445	574	109	136	1052	1524
<b>Total</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>1392</b>	<b>1392</b>	<b>312</b>	<b>312</b>	<b>11134</b>	<b>11134</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>13999</b>	<b>13910</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