

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de julio de 2024**  
**Fecha de Información: 03 de julio 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\$3597 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.88%<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	582,3	717,3	408,4	265,3	24,8	33,0	284,0
15-35	1006,7	1548,1	838,7	208,6	49,9	138,5	659,5
36-60	38,2	121,6	80,0	0,0	21,6	18,2	20,0
61-90	99,0	285,1	205,9	42,3	24,2	1,7	55,0
91-180	124,1	70,5	19,7	94,8	25,9	4,3	25,0
>180	33,5	19,0	12,0	13,0	2,0	15,5	5,0
<b>Total</b>	<b>1883,8</b>	<b>2761,6</b>	<b>1564,6</b>	<b>624,0</b>	<b>148,4</b>	<b>211,3</b>	<b>1048,5</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	6.24%	6.34%	5.21%	5.94%
15-35	6.26%	5.90%	5.09%	5.90%
36-60	6.15%	6.06%	5.92%	6.05%
61-90	5.37%	5.69%	5.63%	5.60%
91-180	5.71%	5.80%	5.69%	5.73%
>180	5.31%	5.66%	5.12%	5.20%
<b>Total</b>	<b>6.19%</b>	<b>5.90%</b>	<b>5.21%</b>	<b>5.88%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . 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	01 – 05 jul.				08 - 12 jul.				15 - 19 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	153	83	3570	5247	150	121	8148	9896	165	129	7157	7363
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3686	1930	0	0	5483	3161	0	0	3960	2491
Otros <sup>c</sup>	83	153	125	203	121	150	1071	1555	129	165	629	1871
<b>Total</b>	<b>236</b>	<b>236</b>	<b>7381</b>	<b>7380</b>	<b>271</b>	<b>271</b>	<b>14702</b>	<b>14612</b>	<b>294</b>	<b>294</b>	<b>11746</b>	<b>11725</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