

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de julio de 2024**  
**Fecha de Información: 12 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\$2185 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.61%<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	351,6	640,2	188,8	165,0	288,4	23,6	163
15-35	553,3	475,6	183,0	297,9	54,6	17,4	238
36-60	31,3	57,3	0,0	0,0	32,3	6,3	25
61-90	260,5	51,8	10,1	0,0	31,7	250,5	10
91-180	32,5	130,6	30,1	0,0	70,6	2,5	30
>180	58,8	47,6	0,0	10,0	7,6	8,8	40
<b>Total</b>	<b>1288,1</b>	<b>1403,1</b>	<b>412,0</b>	<b>472,9</b>	<b>485,2</b>	<b>309,2</b>	<b>506</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	5.83%		5.44%	4.78%	5.40%
15-35	5.83%		5.88%	5.66%	5.79%
36-60	5.82%		5.99%	5.64%	5.88%
61-90	5.84%		5.84%	5.63%	5.66%
91-180	5.75%		5.69%	5.14%	5.69%
>180	5.36%		5.63%	5.07%	5.31%
<b>Total</b>	<b>5.79%</b>		<b>5.62%</b>	<b>5.44%</b>	<b>5.61%</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	08 – 12 jul.				15 - 19 jul.				22 - 26 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	21	29	1211	1154	194	154	8524	9431	189	186	5431	6939
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	659	632	0	0	4757	3136	0	0	4234	2088
Otros <sup>c</sup>	29	21	59	142	154	194	1411	2083	186	189	475	1067
<b>Total</b>	<b>50</b>	<b>50</b>	<b>1929</b>	<b>1928</b>	<b>348</b>	<b>348</b>	<b>14692</b>	<b>14650</b>	<b>375</b>	<b>375</b>	<b>10140</b>	<b>10094</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