

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de julio de 2024**  
**Fecha de Información: 18 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\$2775 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.22%<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	393,6	387,6	134,8	197,0	131,8	75,6	121,0
15-35	909,1	1131,7	634,5	182,8	8,1	237,4	489,0
36-60	46,7	57,6	0,0	0,0	17,6	6,7	40,0
61-90	25,9	141,0	115,0	0,0	11,0	10,9	15,0
91-180	100,0	132,3	105,0	20,0	17,3	70,0	10,0
>180	82,2	122,4	40,0	0,0	2,3	2,1	80,1
<b>Total</b>	<b>1557,6</b>	<b>1972,6</b>	<b>1029,3</b>	<b>399,8</b>	<b>188,1</b>	<b>402,7</b>	<b>755,2</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	6.36%		6.39%	6.19%	6.30%
15-35	6.28%		6.30%	6.28%	6.29%
36-60	6.12%		6.28%	5.79%	6.13%
61-90	6.14%		6.07%	5.97%	6.07%
91-180	5.99%		6.02%	5.86%	5.91%
>180	5.37%		5.61%	5.24%	5.40%
<b>Total</b>	<b>6.18%</b>		<b>6.28%</b>	<b>6.18%</b>	<b>6.22%</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	15 – 19 jul.				22 - 26 jul.				29 jul. - 02 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	92	72	3856	3895	308	215	6959	7914	220	236	6364	8195
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1847	1709	0	0	4513	3097	0	0	4905	2405
Otros <sup>c</sup>	72	92	561	644	215	308	756	1171	236	220	737	1371
<b>Total</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>6264</b>	<b>6248</b>	<b>523</b>	<b>523</b>	<b>12228</b>	<b>12182</b>	<b>456</b>	<b>456</b>	<b>12006</b>	<b>11971</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