

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 25 de julio de 2024**  
**Fecha de Información: 23 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\$2656 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.58%<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	700,2	342,0	167,6	580,2	147,0	92,5	27,5
15-35	541,6	723,3	571,1	213,5	12,1	188,1	140,0
36-60	11,9	8,0	0,0	10,0	8,0	1,9	0,0
61-90	90,6	42,5	0,0	46,2	1,9	3,7	40,7
91-180	93,3	25,6	10,0	44,4	5,6	38,8	10,0
>180	161,7	188,2	131,4	99,6	2,2	7,5	54,6
<b>Total</b>	<b>1599,3</b>	<b>1329,7</b>	<b>880,1</b>	<b>993,9</b>	<b>176,8</b>	<b>332,5</b>	<b>272,8</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	6.62%	6.78%	6.58%	6.67%
15-35	6.74%	6.85%	6.52%	6.71%
36-60	—	6.60%	6.34%	6.55%
61-90	6.37%	6.58%	6.16%	6.36%
91-180	6.25%	6.09%	6.06%	6.08%
>180	5.55%	5.58%	5.42%	5.55%
<b>Total</b>	<b>6.42%</b>	<b>6.74%</b>	<b>6.49%</b>	<b>6.58%</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	22 – 26 jul.				29 jul. - 02 ago.				05 - 09 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	300	188	6273	6884	302	240	6615	8564	207	92	4990	7131
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3864	3027	0	0	4988	2494	0	0	4442	2085
Otros <sup>c</sup>	188	300	924	1105	240	302	951	1464	92	207	249	419
<b>Total</b>	<b>488</b>	<b>488</b>	<b>11061</b>	<b>11016</b>	<b>542</b>	<b>542</b>	<b>12554</b>	<b>12522</b>	<b>299</b>	<b>299</b>	<b>9681</b>	<b>9635</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