

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de julio de 2024**  
**Fecha de Información: 25 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\$3699 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.16%<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	729,0	397,2	36,0	393,7	88,2	62,3	273,0
15-35	791,6	1432,2	908,0	278,7	31,6	20,4	492,5
36-60	84,3	15,0	0,0	0,0	15,0	84,3	0,0
61-90	78,9	31,1	16,9	45,0	8,9	28,5	5,4
91-180	149,7	223,0	171,1	10,0	26,9	114,7	25,0
>180	433,1	471,0	128,0	90,1	2,0	2,0	340,9
<b>Total</b>	<b>2266,5</b>	<b>2569,5</b>	<b>1260,0</b>	<b>817,6</b>	<b>172,7</b>	<b>312,2</b>	<b>1136,8</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	6.30%	6.02%	6.08%	6.16%
15-35	6.34%	6.42%	6.19%	6.37%
36-60	—	6.47%	6.23%	6.27%
61-90	6.20%	6.59%	6.16%	6.21%
91-180	6.10%	5.98%	5.96%	5.98%
>180	5.46%	5.72%	5.57%	5.49%
<b>Total</b>	<b>6.06%</b>	<b>6.31%</b>	<b>6.10%</b>	<b>6.16%</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	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>	198	108	2661	3056	318	241	7549	9199	295	93	5291	7319
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1789	1311	0	0	5022	3135	0	0	4482	2247
Otros <sup>c</sup>	108	198	226	299	241	318	1303	1507	93	295	276	428
<b>Total</b>	<b>306</b>	<b>306</b>	<b>4676</b>	<b>4666</b>	<b>559</b>	<b>559</b>	<b>13874</b>	<b>13841</b>	<b>388</b>	<b>388</b>	<b>10049</b>	<b>9994</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