

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de mayo de 2024**  
**Fecha de Información: 06 de mayo 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\$3265 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.74%<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	669,1	430,1	247,9	481,6	4,2	9,5	178,0
15-35	912,8	1048,4	685,5	619,6	130,9	61,2	232,0
36-60	51,5	106,2	50,0	0,0	8,2	3,5	48,0
61-90	83,6	36,3	0,0	80,4	36,3	3,1	0,0
91-180	62,0	111,1	47,5	0,0	23,6	22,0	40,0
>180	126,5	141,7	120,0	110,0	5,2	0,0	16,5
<b>Total</b>	<b>1905,4</b>	<b>1873,7</b>	<b>1150,8</b>	<b>1291,6</b>	<b>208,4</b>	<b>99,3</b>	<b>514,5</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	6.35%		6.45%	5.60%	5.95%
15-35	6.36%		5.68%	5.00%	5.60%
36-60	6.32%		6.49%	5.96%	6.34%
61-90	-		6.15%	6.05%	6.14%
91-180	6.16%		6.13%	5.87%	6.09%
>180	5.54%		5.77%	5.46%	5.59%
<b>Total</b>	<b>6.31%</b>		<b>5.79%</b>	<b>5.28%</b>	<b>5.74%</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	06 – 10 may.				13 - 17 may.				20 - 24 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	258	142	9857	10682	61	140	6149	7237	44	240	6623	8191
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5210	4478	0	0	4136	2736	0	1	4949	2812
Otros <sup>c</sup>	142	258	1165	1024	140	61	771	1061	240	43	636	1159
<b>Total</b>	<b>400</b>	<b>400</b>	<b>16232</b>	<b>16184</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>11056</b>	<b>11034</b>	<b>284</b>	<b>284</b>	<b>12208</b>	<b>12162</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.