

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 02 de mayo de 2024**  
**Fecha de Información: 29 de abril 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\$4437 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.85%<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	727,7	255,3	124,5	596,2	12,3	13,0	118,5
15-35	1001,9	1419,9	607,1	249,1	115,2	55,3	697,5
36-60	215,3	164,6	5,0	8,0	39,6	87,3	120,0
61-90	267,6	424,3	340,0	195,0	14,1	2,4	70,2
91-180	282,3	463,9	251,5	180,0	112,5	2,3	100,0
>180	184,6	201,1	125,7	86,2	10,3	33,4	65,0
<b>Total</b>	<b>2679,5</b>	<b>2929,0</b>	<b>1453,8</b>	<b>1314,6</b>	<b>304,0</b>	<b>193,7</b>	<b>1171,2</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	6.08%	6.12%	6.00%	6.04%
15-35	6.05%	5.70%	5.08%	5.75%
36-60	6.03%	6.12%	5.99%	6.03%
61-90	6.12%	6.16%	5.76%	6.14%
91-180	5.93%	5.85%	5.94%	5.90%
>180	5.61%	5.63%	5.50%	5.59%
<b>Total</b>	<b>6.02%</b>	<b>5.81%</b>	<b>5.58%</b>	<b>5.85%</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	29 abr. - 03 may.				06 - 10 may.				13 - 17 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	117	249	8774	9737	232	137	7856	8595	55	135	5638	6932
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5005	4105	0	0	4227	3348	0	0	4035	2444
Otros <sup>c</sup>	249	117	1199	1130	137	232	920	1011	135	55	762	1038
<b>Total</b>	<b>366</b>	<b>366</b>	<b>14978</b>	<b>14972</b>	<b>369</b>	<b>369</b>	<b>13003</b>	<b>12954</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>10435</b>	<b>10414</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.