

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de mayo de 2024**  
**Fecha de Información: 30 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\$4463 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.65%<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         | 1052,5                         | 891,4         | 529,6                               | 907,3         | 232,7         | 16,2         | 129,0                                |
| 15-35        | 608,1                          | 1057,2        | 777,8                               | 369,2         | 61,3          | 20,8         | 218,0                                |
| 36-60        | 241,9                          | 274,3         | 162,2                               | 75,1          | 16,8          | 71,5         | 95,3                                 |
| 61-90        | 53,8                           | 13,5          | 0,4                                 | 47,0          | 12,3          | 6,1          | 0,7                                  |
| 91-180       | 290,4                          | 191,7         | 128,5                               | 0,0           | 30,9          | 258,1        | 32,3                                 |
| >180         | 154,5                          | 142,3         | 104,6                               | 110,8         | 4,3           | 10,3         | 33,4                                 |
| <b>Total</b> | <b>2401,1</b>                  | <b>2570,3</b> | <b>1703,2</b>                       | <b>1509,4</b> | <b>358,4</b>  | <b>383,0</b> | <b>508,7</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         | 6.02%   | 2.76%                        | 5.96%        | 4.76%        |
| 15-35        | 5.99%   | 6.09%                        | 5.96%        | 6.04%        |
| 36-60        | 6.07%   | 6.14%                        | 5.79%        | 6.04%        |
| 61-90        | 5.85%   | 6.16%                        | 5.73%        | 6.01%        |
| 91-180       | 5.91%   | 5.90%                        | 5.54%        | 5.65%        |
| >180         | 5.46%   | 5.56%                        | 5.52%        | 5.52%        |
| <b>Total</b> | <b>5.97%</b>                                      | <b>5.37%</b>                 | <b>5.81%</b> | <b>5.65%</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                            | 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>      | 108               | 121        | 6475         | 6768         | 235          | 138        | 8336         | 9469         | 55           | 136        | 5796         | 7038         |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0                 | 0          | 3254         | 2934         | 0            | 0          | 4655         | 3607         | 0            | 0          | 4073         | 2526         |
| Otros <sup>c</sup>                  | 121               | 108        | 608          | 630          | 138          | 235        | 1152         | 1017         | 136          | 55         | 766          | 1050         |
| <b>Total</b>                        | <b>229</b>        | <b>229</b> | <b>10337</b> | <b>10332</b> | <b>373</b>   | <b>373</b> | <b>14143</b> | <b>14093</b> | <b>191</b>   | <b>191</b> | <b>10635</b> | <b>10614</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.