

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2024**  
**Fecha de Información: 15 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\$3328 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.78%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	867,5	242,3	132,6	769,9	32,7	20,6	77
15-35	436,7	924,3	792,5	283,0	44,8	66,7	87
36-60	17,6	31,8	0,0	10,0	31,8	7,6	0
61-90	75,3	131,8	10,1	40,4	101,7	14,9	20
91-180	272,0	206,3	31,5	140,0	69,8	27,0	105
>180	176,4	289,9	206,1	116,5	28,8	5,0	55
<b>Total</b>	<b>1845,5</b>	<b>1826,5</b>	<b>1172,8</b>	<b>1359,7</b>	<b>309,8</b>	<b>141,8</b>	<b>344</b>

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

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

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

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.93%	5.91%	5.52%	5.67%
15-35	5.88%	5.93%	5.81%	5.87%
36-60	–	6.29%	2.58%	5.58%
61-90	5.93%	6.14%	5.74%	6.07%
91-180	5.78%	5.86%	5.57%	5.79%
>180	5.32%	5.86%	5.28%	5.50%
<b>Total</b>	<b>5.77%</b>	<b>5.96%</b>	<b>5.59%</b>	<b>5.78%</b>

<sup>a</sup> Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

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.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	13 - 17 may.				20 - 24 may.				27 - 31 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	134	125	5752	5906	58	257	7549	8977	40	405	6018	6969
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3240	2845	0	1	5183	3269	0	0	3692	2165
Otros <sup>c</sup>	125	134	694	924	257	57	771	1210	405	40	713	1273
<b>Total</b>	<b>259</b>	<b>259</b>	<b>9686</b>	<b>9675</b>	<b>315</b>	<b>315</b>	<b>13503</b>	<b>13456</b>	<b>445</b>	<b>445</b>	<b>10423</b>	<b>10407</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.