

# 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.