

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2024**  
**Fecha de Información: 17 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\$3468 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.48%<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	374,2	636,5	258,1	330,6	368,4	33,6	10,0
15-35	610,7	875,8	562,0	249,5	34,1	81,6	279,7
36-60	100,7	74,1	0,0	0,0	10,1	36,7	64,0
61-90	299,3	113,0	0,0	18,0	53,0	221,3	60,0
91-180	288,0	240,9	70,0	86,0	50,9	82,1	120,0
>180	241,9	296,7	70,9	89,8	75,8	2,1	150,0
<b>Total</b>	<b>1914,8</b>	<b>2237,0</b>	<b>961,0</b>	<b>773,8</b>	<b>592,3</b>	<b>457,4</b>	<b>683,7</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	6.34%	3.67%	5.02%	4.05%
15-35	6.31%	6.33%	5.98%	6.26%
36-60	6.26%	6.36%	6.01%	6.19%
61-90	6.06%	6.18%	5.50%	5.71%
91-180	5.64%	5.69%	5.64%	5.66%
>180	5.39%	5.67%	5.18%	5.42%
<b>Total</b>	<b>5.97%</b>	<b>5.14%</b>	<b>5.52%</b>	<b>5.48%</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>	94	39	778	824	70	255	8040	9863	43	407	6268	7219
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	296	234	0	1	5449	3689	0	0	3876	2374
Otros <sup>c</sup>	39	94	66	81	255	69	1335	1226	407	43	753	1288
<b>Total</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>1140</b>	<b>1139</b>	<b>325</b>	<b>325</b>	<b>14824</b>	<b>14778</b>	<b>450</b>	<b>450</b>	<b>10897</b>	<b>10881</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.