

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2024**  
**Fecha de Información: 27 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\$277 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.40%<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         | 117,7                          | 116,8        | 9,0                                  | 11,6        | 7,8           | 6,1         | 100                |
| 15-35        | 49,7                           | 77,7         | 50,0                                 | 16,9        | 1,7           | 6,8         | 26                 |
| 36-60        | 5,8                            | 10,3         | 7,5                                  | 0,0         | 2,8           | 5,8         | 0                  |
| 61-90        | 0,7                            | 1,6          | 0,3                                  | 0,0         | 1,3           | 0,7         | 0                  |
| 91-180       | 6,0                            | 1,6          | 0,0                                  | 5,6         | 1,6           | 0,4         | 0                  |
| >180         | 4,8                            | 10,3         | 4,7                                  | 4,7         | 5,6           | 0,1         | 0                  |
| <b>Total</b> | <b>184,7</b>                   | <b>218,2</b> | <b>71,5</b>                          | <b>38,8</b> | <b>20,6</b>   | <b>19,8</b> | <b>126</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         | 6.00%   | 7.02%                        | 6.98%        | 6.12%        |
| 15-35        | 6.94%   | 6.71%                        | 6.63%        | 6.75%        |
| 36-60        | –   | 7.14%                        | 6.34%        | 6.60%        |
| 61-90        | –   | 6.42%                        | 6.32%        | 6.38%        |
| 91-180       | –   | 5.62%                        | 5.99%        | 5.69%        |
| >180         | –   | 5.63%                        | 5.54%        | 5.63%        |
| <b>Total</b> | <b>6.19%</b>                                      | <b>6.64%</b>                 | <b>6.63%</b> | <b>6.40%</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                            | 27 – 31 may. |            |              |              | 03 - 07 jun. |            |              |              | 10 - 14 jun. |            |              |              |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
|                                     | Delivery     |            | NDF          |              | Delivery     |            | NDF          |              | Delivery     |            | NDF          |              |
|                                     | C            | V          | C            | V            | C            | V          | C            | V            | C            | V          | C            | V            |
| Sector Financiero <sup>a</sup>      | 64           | 419        | 7540         | 8697         | 101          | 139        | 7213         | 8055         | 30           | 148        | 6327         | 7260         |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0          | 4634         | 3365         | 0            | 0          | 4525         | 2984         | 0            | 0          | 4459         | 2693         |
| Otros <sup>c</sup>                  | 419          | 64         | 1309         | 1406         | 139          | 101        | 695          | 1391         | 148          | 30         | 461          | 1287         |
| <b>Total</b>                        | <b>483</b>   | <b>483</b> | <b>13483</b> | <b>13468</b> | <b>240</b>   | <b>240</b> | <b>12433</b> | <b>12430</b> | <b>178</b>   | <b>178</b> | <b>11247</b> | <b>11240</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.