

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de junio de 2024**  
**Fecha de Información: 30 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\$3473 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.32%<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         | 1136,7                         | 434,1         | 215,6                                | 960,3         | 62,0          | 19,9         | 156,5              |
| 15-35        | 431,1                          | 1323,9        | 978,9                                | 75,7          | 53,5          | 64,0         | 291,5              |
| 36-60        | 68,1                           | 11,1          | 0,0                                  | 0,0           | 11,1          | 68,1         | 0,0                |
| 61-90        | 88,2                           | 82,1          | 22,4                                 | 31,2          | 19,3          | 16,7         | 40,4               |
| 91-180       | 61,3                           | 114,1         | 42,3                                 | 0,0           | 41,5          | 31,0         | 30,3               |
| >180         | 180,9                          | 120,4         | 56,5                                 | 68,6          | 3,6           | 52,1         | 60,3               |
| <b>Total</b> | <b>1966,3</b>                  | <b>2085,8</b> | <b>1315,7</b>                        | <b>1135,7</b> | <b>191,1</b>  | <b>251,6</b> | <b>579,0</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         | 6.31%   | 6.24%                        | 6.63%        | 6.48%        |
| 15-35        | 6.30%   | 6.50%                        | 6.23%        | 6.43%        |
| 36-60        | –   | 6.40%                        | 6.17%        | 6.20%        |
| 61-90        | 5.98%   | 5.96%                        | 5.99%        | 5.97%        |
| 91-180       | 5.79%   | 5.81%                        | 5.72%        | 5.78%        |
| >180         | 5.52%   | 5.59%                        | 5.31%        | 5.39%        |
| <b>Total</b> | <b>6.17%</b>                                      | <b>6.39%</b>                 | <b>6.34%</b> | <b>6.32%</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>      | 49           | 214        | 5624        | 5536        | 115          | 146        | 8458         | 8817         | 39           | 149        | 6717         | 7671         |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0          | 3064        | 2994        | 0            | 0          | 4902         | 3982         | 0            | 0          | 4770         | 3032         |
| Otros <sup>c</sup>                  | 214          | 49         | 570         | 713         | 146          | 115        | 863          | 1419         | 149          | 39         | 532          | 1308         |
| <b>Total</b>                        | <b>263</b>   | <b>263</b> | <b>9258</b> | <b>9243</b> | <b>261</b>   | <b>261</b> | <b>14223</b> | <b>14218</b> | <b>188</b>   | <b>188</b> | <b>12019</b> | <b>12011</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.