

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de abril de 2024**  
**Fecha de Información: 22 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\$3115 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.17%<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	661,8	597,7	200,0	393,1	156,7	27,7	241
15-35	763,0	846,1	581,4	474,5	13,7	37,6	251
36-60	67,1	99,4	32,0	19,1	32,4	13,0	35
61-90	1,9	5,5	0,0	0,0	5,5	1,9	0
91-180	289,2	305,5	191,6	55,0	18,8	139,2	95
>180	40,7	68,6	45,0	30,0	13,6	0,7	10
<b>Total</b>	<b>1823,7</b>	<b>1922,9</b>	<b>1050,0</b>	<b>971,7</b>	<b>240,8</b>	<b>220,0</b>	<b>632</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	6.97%	3.12%	6.59%	5.44%
15-35	6.91%	6.76%	6.82%	6.81%
36-60	6.55%	6.86%	6.85%	6.77%
61-90	–	6.69%	6.40%	6.62%
91-180	6.36%	6.31%	5.74%	6.11%
>180	5.83%	5.81%	5.59%	5.74%
<b>Total</b>	<b>6.81%</b>	<b>5.57%</b>	<b>6.49%</b>	<b>6.17%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . 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	22 – 26 abr.				29 abr. - 03 may.				06 - 10 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	215	229	7781	9019	104	245	6977	8113	217	132	6662	8104
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	9	4125	3232	0	0	3901	2931	0	0	3953	2389
Otros <sup>c</sup>	229	206	1292	935	245	104	1045	873	132	217	892	966
<b>Total</b>	<b>444</b>	<b>444</b>	<b>13198</b>	<b>13186</b>	<b>349</b>	<b>349</b>	<b>11923</b>	<b>11917</b>	<b>349</b>	<b>349</b>	<b>11507</b>	<b>11459</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.