

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 25 de abril de 2024**  
**Fecha de Información: 23 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\$5173 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.75%<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	646,3	475,6	435,2	629,0	34,3	11,3	6,0
15-35	1260,0	1817,6	1124,8	697,5	176,8	46,5	516,0
36-60	135,4	467,9	360,0	30,0	7,4	4,8	100,6
61-90	51,7	35,2	0,3	0,0	34,8	51,7	0,0
91-180	417,4	177,5	75,0	280,0	12,5	47,4	90,0
>180	296,3	149,8	90,0	151,3	14,8	100,0	45,0
<b>Total</b>	<b>2807,2</b>	<b>3123,5</b>	<b>2085,3</b>	<b>1787,8</b>	<b>280,6</b>	<b>261,8</b>	<b>757,6</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	6.75%		7.01%	5.25%	5.68%
15-35	6.57%		5.56%	5.27%	5.73%
36-60	6.49%		5.17%	6.31%	5.59%
61-90	-		6.34%	6.26%	6.29%
91-180	6.17%		5.94%	6.06%	6.06%
>180	5.99%		5.83%	5.74%	5.81%
<b>Total</b>	<b>6.48%</b>		<b>5.64%</b>	<b>5.42%</b>	<b>5.75%</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>	210	153	6925	7841	104	250	7141	8535	219	135	7319	8302
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	9	3643	3062	0	0	4293	3087	0	0	4038	2922
Otros <sup>c</sup>	153	201	1238	891	250	104	1074	880	135	219	894	977
<b>Total</b>	<b>363</b>	<b>363</b>	<b>11806</b>	<b>11794</b>	<b>354</b>	<b>354</b>	<b>12508</b>	<b>12502</b>	<b>354</b>	<b>354</b>	<b>12251</b>	<b>12201</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.