

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de abril de 2024**  
**Fecha de Información: 01 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\$2618 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.00%<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	695,4	506,3	134,0	311,4	2,8	14,5	369,5
15-35	583,7	932,5	405,4	118,2	84,1	22,5	443,0
36-60	276,1	66,5	10,1	240,0	26,4	6,1	30,0
61-90	7,5	200,9	170,0	0,0	25,9	2,5	5,0
91-180	0,8	96,5	0,0	0,0	96,5	0,8	0,0
>180	85,8	93,7	6,7	5,8	6,9	0,0	80,0
<b>Total</b>	<b>1649,4</b>	<b>1896,3</b>	<b>726,2</b>	<b>675,4</b>	<b>242,6</b>	<b>46,5</b>	<b>927,5</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	6.05%	5.41%	5.60%	5.81%
15-35	6.00%	6.11%	5.39%	5.98%
36-60	6.07%	6.14%	5.91%	6.09%
61-90	6.20%	6.16%	5.97%	6.16%
91-180	–	7.36%	5.82%	7.35%
>180	5.91%	5.97%	5.50%	5.92%
<b>Total</b>	<b>6.02%</b>	<b>6.19%</b>	<b>5.56%</b>	<b>6.00%</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	01 – 05 abr.				08 - 12 abr.				15 - 19 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	130	171	8459	8900	73	126	5190	5768	170	123	5445	5788
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4575	4188	0	0	3133	2297	0	0	3068	2042
Otros <sup>c</sup>	171	130	798	733	126	73	394	649	123	170	352	1033
<b>Total</b>	<b>301</b>	<b>301</b>	<b>13832</b>	<b>13821</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>8717</b>	<b>8714</b>	<b>293</b>	<b>293</b>	<b>8865</b>	<b>8863</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.