

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de abril de 2024**  
**Fecha de Información: 04 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\$2945 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.08%<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	827,9	548,4	145,6	464,8	54,6	14,8	348,2
15-35	721,0	942,6	477,9	249,7	38,0	44,6	426,8
36-60	24,7	48,7	4,0	0,0	44,6	24,5	0,2
61-90	109,9	156,1	100,0	0,6	31,1	84,3	25,0
91-180	74,4	157,1	75,0	0,0	82,1	74,4	0,0
>180	31,3	112,7	70,0	20,0	32,7	1,3	10,0
<b>Total</b>	<b>1789,2</b>	<b>1965,7</b>	<b>872,5</b>	<b>735,1</b>	<b>283,1</b>	<b>244,0</b>	<b>810,1</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	6.31%		5.36%	5.75%	5.90%
15-35	6.24%		6.29%	5.91%	6.19%
36-60	5.95%		6.50%	6.16%	6.38%
61-90	6.27%		6.11%	6.13%	6.14%
91-180	-		6.30%	6.09%	6.20%
>180	6.00%		6.04%	5.44%	5.95%
<b>Total</b>	<b>6.27%</b>		<b>6.10%</b>	<b>5.87%</b>	<b>6.08%</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	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>	93	88	4069	4087	84	149	5967	6634	175	130	5817	6070
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2314	2158	0	0	3338	2594	0	0	3147	2261
Otros <sup>c</sup>	88	93	88	216	149	84	594	661	130	175	422	1052
<b>Total</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>6471</b>	<b>6461</b>	<b>233</b>	<b>233</b>	<b>9899</b>	<b>9889</b>	<b>305</b>	<b>305</b>	<b>9386</b>	<b>9383</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.