

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de abril de 2024**  
**Fecha de Información: 12 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\$3461 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.68%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>3</sup>

| Rango        | Sector Financiero <sup>2</sup> |               | Intragrupa y Off-shore <sup>3</sup> |              | Otros Agentes |              | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
|              | Compras                        | Ventas        | Compras                             | Ventas       | Compras       | Ventas       |                                      |
| 3-14         | 579,4                          | 358,5         | 193,7                               | 388,0        | 26,8          | 53,4         | 138                                  |
| 15-35        | 873,3                          | 1550,5        | 919,5                               | 252,3        | 41,0          | 31,1         | 590                                  |
| 36-60        | 140,2                          | 122,7         | 0,0                                 | 0,0          | 28,7          | 46,2         | 94                                   |
| 61-90        | 185,7                          | 97,0          | 50,0                                | 125,0        | 17,0          | 30,7         | 30                                   |
| 91-180       | 121,0                          | 257,7         | 180,0                               | 52,0         | 21,7          | 13,0         | 56                                   |
| >180         | 31,0                           | 71,9          | 50,0                                | 10,0         | 1,9           | 1,0          | 20                                   |
| <b>Total</b> | <b>1930,6</b>                  | <b>2458,3</b> | <b>1393,2</b>                       | <b>827,3</b> | <b>137,1</b>  | <b>175,4</b> | <b>928</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         | 7.03%   | 6.13%                        | 6.46%        | 6.51%        |
| 15-35        | 7.04%   | 6.58%                        | 6.57%        | 6.77%        |
| 36-60        | 7.07%   | 6.94%                        | 6.65%        | 6.93%        |
| 61-90        | 6.81%   | 7.23%                        | 6.54%        | 6.79%        |
| 91-180       | 6.44%   | 6.41%                        | 6.50%        | 6.44%        |
| >180         | 6.13%   | 5.83%                        | 5.32%        | 5.98%        |
| <b>Total</b> | <b>6.98%</b>                                      | <b>6.52%</b>                 | <b>6.50%</b> | <b>6.68%</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                             | 08 - 12 abr. |           |             |             | 15 - 19 abr. |            |              |              | 22 - 26 abr. |            |              |              |
|--------------------------------------|--------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
|                                      | Delivery     |           | NDF         |             | Delivery     |            | NDF          |              | Delivery     |            | NDF          |              |
|                                      | C            | V         | C           | V           | C            | V          | C            | V            | C            | V          | C            | V            |
| Sector Financiero <sup>a</sup>       | 19           | 32        | 1161        | 1137        | 279          | 140        | 7549         | 7636         | 187          | 224        | 6236         | 7368         |
| Intragruppo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0         | 572         | 593         | 0            | 0          | 3642         | 3299         | 0            | 0          | 3719         | 2547         |
| Otros <sup>c</sup>                   | 32           | 19        | 181         | 184         | 140          | 279        | 888          | 1141         | 224          | 187        | 848          | 875          |
| <b>Total</b>                         | <b>51</b>    | <b>51</b> | <b>1914</b> | <b>1914</b> | <b>419</b>   | <b>419</b> | <b>12079</b> | <b>12076</b> | <b>411</b>   | <b>411</b> | <b>10803</b> | <b>10790</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.