

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de abril de 2024**  
**Fecha de Información: 19 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\$2548 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.01%<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	530,3	476,4	122,1	205,1	51,3	22,2	303
15-35	548,8	841,7	349,8	230,5	224,9	51,3	267
36-60	10,8	9,8	0,0	0,0	9,8	10,8	0
61-90	361,6	91,8	20,0	80,0	1,8	211,6	70
91-180	118,6	185,8	95,8	0,2	15,0	43,4	75
>180	79,6	53,4	5,0	20,0	3,4	14,6	45
<b>Total</b>	<b>1649,6</b>	<b>1658,8</b>	<b>592,7</b>	<b>535,8</b>	<b>306,2</b>	<b>353,8</b>	<b>760</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	7.18%	7.24%	7.21%	7.20%
15-35	7.14%	7.29%	7.09%	7.21%
36-60	-	7.12%	6.79%	6.95%
61-90	6.81%	7.13%	6.73%	6.75%
91-180	6.59%	6.63%	6.42%	6.58%
>180	5.85%	6.24%	5.84%	5.88%
<b>Total</b>	<b>7.00%</b>	<b>7.17%</b>	<b>6.87%</b>	<b>7.01%</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	15 – 19 abr.				22 - 26 abr.				29 abr. - 03 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	45	36	646	647	213	229	7455	8823	102	245	6741	7809
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	236	205	0	9	4065	3048	0	0	3841	2801
Otros <sup>c</sup>	36	45	32	61	229	204	1290	927	245	102	891	857
<b>Total</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>914</b>	<b>913</b>	<b>442</b>	<b>442</b>	<b>12810</b>	<b>12798</b>	<b>347</b>	<b>347</b>	<b>11473</b>	<b>11467</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.