

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de febrero de 2024**  
**Fecha de Información: 06 de febrero 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\$4332 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.86%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupa y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	878,6	909,5	347,5	460,6	242,0	98,0	320,0
15-35	862,2	1337,1	475,0	224,0	272,0	48,1	590,1
36-60	139,8	111,0	0,0	10,5	101,0	119,3	10,0
61-90	178,6	20,6	11,0	45,0	9,6	133,6	0,0
91-180	283,6	21,8	0,5	0,0	21,3	283,6	0,0
>180	353,7	429,7	147,4	60,5	8,3	19,2	274,0
<b>Total</b>	<b>2696,5</b>	<b>2829,7</b>	<b>981,5</b>	<b>800,6</b>	<b>654,2</b>	<b>701,8</b>	<b>1194,1</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	7.72%		7.70%	7.24%	7.55%
15-35	7.76%		5.10%	7.62%	6.48%
36-60	7.49%		7.73%	7.59%	7.65%
61-90	-		7.34%	7.28%	7.28%
91-180	-		7.38%	6.02%	6.12%
>180	6.38%		6.43%	5.34%	6.33%
<b>Total</b>	<b>7.43%</b>		<b>6.17%</b>	<b>7.03%</b>	<b>6.86%</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	05 - 09 feb.				12 - 16 feb.				19 - 23 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	62	108	6487	7162	105	162	7582	8928	30	204	8504	6680
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3911	3080	0	0	4931	3119	0	0	3874	3337
Otros <sup>c</sup>	108	62	1152	1256	162	105	953	1405	204	30	742	3071
<b>Total</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>11550</b>	<b>11498</b>	<b>267</b>	<b>267</b>	<b>13466</b>	<b>13452</b>	<b>234</b>	<b>234</b>	<b>13120</b>	<b>13088</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.