

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 09 de febrero de 2024**  
**Fecha de Información: 07 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\$4287 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.43%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1192,0	1060,6	545,4	651,1	38,6	64,2	476,6
15-35	1089,2	1188,3	421,7	335,5	46,4	33,4	720,3
36-60	82,7	96,6	86,9	55,7	9,8	27,0	0,0
61-90	198,8	177,4	151,1	100,9	7,2	78,9	19,0
91-180	11,7	13,9	0,0	5,2	13,9	6,5	0,0
>180	131,4	270,5	256,2	118,5	4,3	2,9	10,0
<b>Total</b>	<b>2705,8</b>	<b>2807,3</b>	<b>1461,3</b>	<b>1267,0</b>	<b>120,1</b>	<b>213,0</b>	<b>1225,9</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	7.59%		7.39%	7.46%	7.49%
15-35	7.57%		7.63%	7.13%	7.52%
36-60	-		7.74%	7.39%	7.44%
61-90	7.10%		7.23%	7.23%	7.22%
91-180	-		7.24%	6.97%	7.15%
>180	6.49%		6.50%	6.08%	6.49%
<b>Total</b>	<b>7.56%</b>		<b>7.35%</b>	<b>7.35%</b>	<b>7.43%</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>	48	94	5248	5861	105	162	8263	9454	31	204	8651	6930
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3494	2794	0	0	5228	3529	0	0	3960	3353
Otros <sup>c</sup>	94	48	535	570	162	105	965	1459	204	31	786	3082
<b>Total</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>9277</b>	<b>9225</b>	<b>267</b>	<b>267</b>	<b>14456</b>	<b>14442</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>13397</b>	<b>13365</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.