

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2024**  
**Fecha de Información: 09 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\$1820 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.40%<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	292,8	405,1	225,8	158,2	51,7	7,1	127,6
15-35	654,7	429,5	154,5	358,9	33,0	53,7	242,0
36-60	34,9	19,0	0,0	16,8	19,0	18,1	0,0
61-90	83,7	106,6	72,7	0,0	13,8	63,7	20,0
91-180	11,7	70,2	45,1	0,0	17,0	3,7	8,0
>180	53,3	86,5	52,5	22,1	4,0	1,2	30,0
<b>Total</b>	<b>1131,1</b>	<b>1116,8</b>	<b>550,6</b>	<b>556,0</b>	<b>138,5</b>	<b>147,5</b>	<b>427,6</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	7.61%		7.65%	6.50%	7.31%
15-35	7.57%		7.55%	7.52%	7.55%
36-60	-		7.81%	7.35%	7.59%
61-90	7.29%		7.43%	7.28%	7.31%
91-180	7.03%		7.19%	7.08%	7.16%
>180	6.41%		6.77%	6.27%	6.54%
<b>Total</b>	<b>7.48%</b>		<b>7.53%</b>	<b>7.21%</b>	<b>7.40%</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>	18	32	288	385	104	172	8756	10077	34	205	6769	7238
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	274	184	0	0	5654	3851	0	0	4133	3353
Otros <sup>c</sup>	32	18	68	36	172	104	1001	1468	205	34	808	1087
<b>Total</b>	<b>50</b>	<b>50</b>	<b>630</b>	<b>605</b>	<b>276</b>	<b>276</b>	<b>15411</b>	<b>15396</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>11710</b>	<b>11678</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.