

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2024**  
**Fecha de Información: 14 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\$3209 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.50%<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	815,6	215,5	66,0	656,8	73,5	82,9	76,0
15-35	764,6	1294,9	715,9	137,8	93,0	140,8	486,0
36-60	134,8	170,0	69,5	51,0	23,9	7,2	76,6
61-90	174,8	121,8	80,2	135,6	6,6	4,2	35,0
91-180	111,9	26,8	18,0	0,0	8,8	111,9	0,0
>180	42,3	24,6	2,4	24,3	7,2	3,0	15,0
<b>Total</b>	<b>2044,0</b>	<b>1853,6</b>	<b>952,0</b>	<b>1005,4</b>	<b>212,9</b>	<b>350,0</b>	<b>688,6</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	7.10%		6.55%	4.84%	5.31%
15-35	7.10%		6.97%	7.01%	7.02%
36-60	7.10%		7.20%	7.04%	7.10%
61-90	6.98%		7.07%	6.96%	7.04%
91-180	-		7.16%	6.84%	6.87%
>180	6.09%		6.43%	6.12%	6.17%
<b>Total</b>	<b>7.07%</b>		<b>6.93%</b>	<b>5.72%</b>	<b>6.50%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	12 - 16 feb.				19 - 23 feb.				26 feb. - 01 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	72	123	7707	8165	36	211	7095	7607	24	241	8405	8591
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4900	4308	0	0	4327	3545	0	0	4657	4107
Otros <sup>c</sup>	123	72	673	793	211	36	867	1107	241	24	910	1260
<b>Total</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>13280</b>	<b>13266</b>	<b>247</b>	<b>247</b>	<b>12289</b>	<b>12259</b>	<b>265</b>	<b>265</b>	<b>13972</b>	<b>13958</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.