

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2024**  
**Fecha de Información: 21 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\$3505 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.61%<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	378,3	614,1	335,2	191,4	119,5	27,5	159,5
15-35	1248,2	1272,2	486,2	400,3	21,5	83,3	764,5
36-60	445,5	235,0	1,0	20,0	7,0	198,5	227,0
61-90	69,2	78,4	29,8	20,0	3,6	4,2	45,0
91-180	109,0	18,8	0,0	0,0	18,8	109,0	0,0
>180	104,3	183,2	126,5	45,8	1,7	3,5	55,0
<b>Total</b>	<b>2354,4</b>	<b>2401,8</b>	<b>978,7</b>	<b>677,5</b>	<b>172,1</b>	<b>426,0</b>	<b>1251,0</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	6.72%		6.72%	6.61%	6.70%
15-35	6.71%		6.62%	6.64%	6.67%
36-60	6.66%		6.71%	6.58%	6.62%
61-90	6.44%		6.53%	6.46%	6.48%
91-180	-		6.65%	6.32%	6.37%
>180	6.13%		6.01%	6.10%	6.05%
<b>Total</b>	<b>6.67%</b>		<b>6.58%</b>	<b>6.56%</b>	<b>6.61%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$ . 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	19 – 23 feb.				26 feb. - 01 mar.				04 - 08 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	34	172	5382	5887	30	246	9244	9870	26	121	6213	6836
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3592	3048	0	0	5158	4430	0	0	3336	2462
Otros <sup>c</sup>	172	34	457	476	246	30	1241	1328	121	26	397	644
<b>Total</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>9431</b>	<b>9411</b>	<b>276</b>	<b>276</b>	<b>15643</b>	<b>15628</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>9946</b>	<b>9942</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.