

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2024**  
**Fecha de Información: 22 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\$2898 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.17%<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	501,9	378,2	242,0	356,2	50,4	59,9	85,8
15-35	747,6	914,7	425,6	262,5	22,1	18,1	467,0
36-60	197,3	173,5	0,0	0,0	6,5	30,3	167,0
61-90	210,0	167,2	11,9	49,9	5,3	10,0	150,0
91-180	80,8	153,0	123,3	0,0	19,7	70,8	10,0
>180	149,2	124,5	102,5	120,5	2,0	8,7	20,0
<b>Total</b>	<b>1886,8</b>	<b>1911,1</b>	<b>905,3</b>	<b>789,2</b>	<b>106,1</b>	<b>197,8</b>	<b>899,8</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	6.55%		5.98%	5.19%	5.64%
15-35	6.54%		6.52%	6.11%	6.47%
36-60	6.39%		6.57%	6.27%	6.38%
61-90	6.40%		5.78%	6.45%	6.39%
91-180	6.30%		6.35%	6.24%	6.29%
>180	6.00%		6.41%	5.70%	5.96%
<b>Total</b>	<b>6.48%</b>		<b>6.26%</b>	<b>5.62%</b>	<b>6.17%</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>	29	134	4637	4797	31	252	9435	10152	28	122	6267	6874
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2922	2728	0	0	5376	4544	0	0	3336	2477
Otros <sup>c</sup>	134	29	354	373	252	31	1285	1384	122	28	398	647
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>7913</b>	<b>7898</b>	<b>283</b>	<b>283</b>	<b>16096</b>	<b>16080</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>10001</b>	<b>9998</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.