

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2024**  
**Fecha de Información: 23 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\$2317 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.12%<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	224,6	503,7	403,2	152,4	50,5	22,2	50
15-35	453,7	780,5	459,6	123,5	17,9	27,2	303
36-60	196,8	95,9	50,0	65,0	5,9	91,8	40
61-90	137,3	142,1	80,0	30,0	17,1	62,3	45
91-180	131,8	67,1	0,0	50,0	17,1	31,8	50
>180	71,2	0,1	0,0	60,0	0,1	11,2	0
<b>Total</b>	<b>1215,5</b>	<b>1589,4</b>	<b>992,8</b>	<b>480,9</b>	<b>108,6</b>	<b>246,5</b>	<b>488</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	6.53%	5.89%	4.71%	5.54%
15-35	6.56%	6.17%	6.30%	6.33%
36-60	6.59%	6.57%	6.27%	6.43%
61-90	6.27%	6.45%	6.41%	6.37%
91-180	5.63%	6.62%	5.83%	5.86%
>180	–	6.37%	5.64%	5.64%
<b>Total</b>	<b>6.43%</b>	<b>6.14%</b>	<b>5.79%</b>	<b>6.12%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . 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>	21	61	867	857	34	253	9617	10567	29	122	6358	7035
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	499	486	0	0	5665	4640	0	0	3415	2477
Otros <sup>c</sup>	61	21	68	90	253	34	1332	1392	122	29	400	657
<b>Total</b>	<b>82</b>	<b>82</b>	<b>1434</b>	<b>1433</b>	<b>287</b>	<b>287</b>	<b>16614</b>	<b>16599</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>10173</b>	<b>10169</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.