

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de marzo de 2024**  
**Fecha de Información: 06 de marzo 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\$2865 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.48%<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	653,6	626,5	239,5	403,5	186,9	50,0	200,1
15-35	900,3	607,0	182,5	427,8	22,3	70,3	402,2
36-60	227,4	192,6	10,0	0,0	32,6	77,4	150,0
61-90	84,2	137,9	55,1	20,0	27,7	9,2	55,0
91-180	67,6	128,5	33,0	0,0	30,5	2,6	65,0
>180	28,0	108,4	70,0	0,0	13,4	3,0	25,0
<b>Total</b>	<b>1961,1</b>	<b>1800,9</b>	<b>590,1</b>	<b>851,3</b>	<b>313,5</b>	<b>212,5</b>	<b>897,3</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	6.66%		6.39%	6.57%	6.52%
15-35	6.57%		6.67%	6.35%	6.51%
36-60	6.56%		6.82%	6.46%	6.56%
61-90	6.39%		6.38%	6.41%	6.39%
91-180	6.30%		6.41%	6.00%	6.32%
>180	5.78%		5.78%	5.38%	5.76%
<b>Total</b>	<b>6.54%</b>		<b>6.44%</b>	<b>6.46%</b>	<b>6.48%</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	04 - 08 mar.				11 - 15 mar.				18 - 22 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	33	88	4860	4990	70	136	5808	6623	37	212	10993	11752
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2538	2272	0	0	3558	2630	0	0	6569	5181
Otros <sup>c</sup>	88	33	220	356	136	70	630	716	212	37	630	1249
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>7618</b>	<b>7618</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>9996</b>	<b>9969</b>	<b>249</b>	<b>249</b>	<b>18192</b>	<b>18182</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.