

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2024**  
**Fecha de Información: 07 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\$2607 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.41%<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	501,8	370,1	199,5	353,9	33,6	10,9	137,0
15-35	766,1	397,4	208,5	601,7	35,5	11,0	153,4
36-60	12,0	26,8	0,5	0,0	25,9	11,6	0,4
61-90	6,7	176,0	127,9	0,0	48,1	6,7	0,0
91-180	149,9	186,1	38,3	20,0	42,7	24,9	105,0
>180	30,6	379,3	375,1	25,0	4,2	5,6	0,0
<b>Total</b>	<b>1467,1</b>	<b>1535,8</b>	<b>949,9</b>	<b>1000,6</b>	<b>190,0</b>	<b>70,7</b>	<b>395,8</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	6.51%		6.52%	6.52%	6.52%
15-35	6.32%		6.69%	6.21%	6.41%
36-60	6.28%		6.73%	6.31%	6.60%
61-90	-		6.47%	6.28%	6.45%
91-180	6.25%		6.32%	6.11%	6.25%
>180	-		5.80%	5.33%	5.74%
<b>Total</b>	<b>6.37%</b>		<b>6.50%</b>	<b>6.35%</b>	<b>6.41%</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	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>	16	58	3728	3801	72	143	6113	6864	38	216	11224	11932
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1931	1627	0	0	3687	2829	0	0	6667	5357
Otros <sup>c</sup>	58	16	67	298	143	72	640	721	216	38	662	1252
<b>Total</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>5726</b>	<b>5726</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>10440</b>	<b>10414</b>	<b>254</b>	<b>254</b>	<b>18553</b>	<b>18541</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.