

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2024**  
**Fecha de Información: 13 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\$4376 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.73%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	1202,4	951,1	369,6	736,0	153,5	38,4	428,0
15-35	700,9	1549,4	1100,6	262,8	34,8	24,1	414,0
36-60	160,9	116,2	0,0	56,9	14,5	2,4	101,7
61-90	99,9	11,8	0,0	0,0	11,8	99,9	0,0
91-180	101,5	111,8	14,6	60,4	57,2	1,1	40,0
>180	186,9	187,2	161,9	154,5	4,8	11,9	20,5
<b>Total</b>	<b>2452,6</b>	<b>2927,5</b>	<b>1646,7</b>	<b>1270,6</b>	<b>276,7</b>	<b>177,8</b>	<b>1004,1</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario <sup>a</sup>	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.21%	5.57%	4.52%	5.26%
15-35	6.23%	6.00%	6.22%	6.10%
36-60	6.23%	6.86%	6.09%	6.31%
61-90	–	6.46%	6.21%	6.23%
91-180	6.18%	6.19%	5.93%	6.18%
>180	5.79%	5.76%	5.80%	5.77%
<b>Total</b>	<b>6.21%</b>	<b>5.90%</b>	<b>5.07%</b>	<b>5.73%</b>

<sup>a</sup> Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

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.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	11 – 15 mar.				18 - 22 mar.				25 - 29 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	71	105	4680	5491	44	229	12760	14135	26	190	1723	2231
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3001	1902	0	0	7681	6145	0	0	878	611
Otros <sup>c</sup>	105	71	473	737	229	44	1148	1296	190	26	471	230
<b>Total</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>8154</b>	<b>8130</b>	<b>273</b>	<b>273</b>	<b>21589</b>	<b>21576</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>3072</b>	<b>3072</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.