

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de marzo de 2024**  
**Fecha de Información: 15 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\$2768 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.18%<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	539,8	469,9	301,4	433,4	96,5	34,4	72
15-35	511,1	517,6	316,6	202,8	56,0	163,3	145
36-60	93,4	140,8	0,0	0,0	51,8	4,4	89
61-90	134,0	196,2	118,7	0,0	62,5	119,0	15
91-180	180,5	129,5	30,0	84,2	69,5	66,3	30
>180	32,7	200,2	141,2	5,6	32,1	0,1	27
<b>Total</b>	<b>1491,4</b>	<b>1654,2</b>	<b>907,8</b>	<b>726,0</b>	<b>368,4</b>	<b>387,4</b>	<b>378</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	5.48%		5.94%	5.38%	5.64%
15-35	6.76%		6.72%	6.23%	6.52%
36-60	6.74%		6.97%	6.12%	6.80%
61-90	6.61%		6.60%	6.47%	6.54%
91-180	6.45%		6.39%	6.23%	6.33%
>180	5.94%		5.91%	5.97%	5.91%
<b>Total</b>	<b>6.42%</b>		<b>6.32%</b>	<b>5.91%</b>	<b>6.18%</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

content	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
Sectores												
Sector Financiero <sup>a</sup>	7	47	515	698	48	241	13448	14959	27	192	1779	2301
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	458	308	0	0	8110	6611	0	0	881	611
Otros <sup>c</sup>	47	7	72	38	241	48	1405	1380	192	27	500	248
<b>Total</b>	<b>54</b>	<b>54</b>	<b>1045</b>	<b>1044</b>	<b>289</b>	<b>289</b>	<b>22963</b>	<b>22950</b>	<b>219</b>	<b>219</b>	<b>3160</b>	<b>3160</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.