

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de marzo de 2024**  
**Fecha de Información: 18 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\$3124 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.55%<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	459,6	443,4	309,4	323,0	49,0	51,6	85,0
15-35	597,3	1404,7	916,7	254,9	195,7	50,1	292,3
36-60	33,2	98,0	23,5	0,0	49,5	8,2	25,0
61-90	111,6	17,4	0,0	0,0	17,4	111,6	0,0
91-180	96,8	77,2	0,1	30,0	57,2	46,8	20,0
>180	90,5	166,4	102,9	40,0	13,4	0,5	50,0
<b>Total</b>	<b>1389,0</b>	<b>2207,0</b>	<b>1352,6</b>	<b>647,9</b>	<b>382,2</b>	<b>268,9</b>	<b>472,3</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	6.83%	5.97%	6.24%	6.22%
15-35	6.83%	6.79%	6.75%	6.80%
36-60	6.86%	6.90%	6.64%	6.87%
61-90	–	6.78%	6.63%	6.65%
91-180	6.62%	6.46%	6.37%	6.43%
>180	6.31%	6.09%	6.28%	6.19%
<b>Total</b>	<b>6.77%</b>	<b>6.53%</b>	<b>6.43%</b>	<b>6.55%</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	18 - 22 mar.				25 - 29 mar.				01 - 05 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	49	241	13967	15257	28	197	1821	2373	116	131	6137	7155
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	8322	6934	0	0	910	611	0	0	4002	2723
Otros <sup>c</sup>	241	49	1445	1531	197	28	502	251	131	116	411	664
<b>Total</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>23734</b>	<b>23722</b>	<b>225</b>	<b>225</b>	<b>3233</b>	<b>3235</b>	<b>247</b>	<b>247</b>	<b>10550</b>	<b>10542</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.