

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2023**  
**Fecha de Información: 26 de diciembre de 2023<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\$2000 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.92%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	430,2	188,9	112,0	292,2	14,9	76,0	62
15-35	350,2	357,5	245,3	291,7	72,3	18,5	40
36-60	66,7	232,0	150,0	0,0	82,0	66,7	0
61-90	112,4	176,5	147,6	111,8	28,8	0,6	0
91-180	68,3	64,4	13,1	10,0	51,3	58,3	0
>180	16,3	48,8	15,5	6,3	23,2	0,0	10
<b>Total</b>	<b>1044,1</b>	<b>1068,0</b>	<b>683,5</b>	<b>712,1</b>	<b>272,5</b>	<b>220,1</b>	<b>112</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	7.62%		7.83%	4.86%	5.69%
15-35	7.45%		7.81%	6.32%	7.23%
36-60	-		7.46%	7.49%	7.47%
61-90	-		7.85%	7.27%	7.84%
91-180	-		7.77%	7.35%	7.54%
>180	6.99%		7.40%	-	7.28%
<b>Total</b>	<b>7.50%</b>		<b>7.68%</b>	<b>6.02%</b>	<b>6.92%</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	25 – 29 dic.				01 - 05 ene.				08 - 12 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	31	274	3516	4146	16	108	3937	6038	67	148	4928	6248
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2470	2163	0	0	4136	2179	0	0	4191	2195
Otros <sup>c</sup>	274	31	788	465	108	16	280	136	148	67	326	483
<b>Total</b>	<b>305</b>	<b>305</b>	<b>6774</b>	<b>6774</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>8353</b>	<b>8353</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>9445</b>	<b>8926</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.