

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de enero de 2024**

**Fecha de Información: 02 de enero 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\$1933 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.11%<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	619,8	201,2	90,3	544,3	40,9	5,5	70
15-35	380,6	870,1	532,5	126,8	94,6	10,9	243
36-60	31,1	45,0	10,0	0,0	25,0	21,1	10
61-90	10,8	19,8	0,0	10,6	19,8	0,2	0
91-180	3,7	11,8	0,7	2,9	11,2	0,9	0
>180	35,1	47,3	22,2	12,5	5,2	2,5	20
<b>Total</b>	<b>1081,1</b>	<b>1195,3</b>	<b>655,6</b>	<b>697,1</b>	<b>196,7</b>	<b>41,0</b>	<b>343</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	7.59%		7.45%	7.19%	7.30%
15-35	7.64%		6.58%	7.21%	6.95%
36-60	7.49%		7.54%	7.20%	7.42%
61-90	-		7.44%	7.06%	7.44%
91-180	-		8.83%	7.06%	8.70%
>180	7.40%		7.37%	6.87%	7.35%
<b>Total</b>	<b>7.61%</b>		<b>6.80%</b>	<b>7.19%</b>	<b>7.11%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	01 – 05 ene.				08 - 12 ene.				15 - 19 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	39	116	4807	6282	85	163	5253	6389	31	224	3856	5354
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4241	2921	0	0	4258	2449	0	0	3806	1797
Otros <sup>c</sup>	116	39	295	141	163	85	344	498	224	31	527	1038
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>9343</b>	<b>9344</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>9855</b>	<b>9336</b>	<b>255</b>	<b>255</b>	<b>8189</b>	<b>8189</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.