

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de enero de 2024**

**Fecha de Información: 03 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\$2838 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.24%<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	967,5	368,1	235,5	734,2	5,1	105,8	127,5
15-35	404,4	935,7	678,0	166,0	28,2	8,9	229,5
36-60	96,6	170,0	65,5	0,0	94,5	86,6	10,0
61-90	0,9	22,1	0,2	0,0	22,0	0,9	0,0
91-180	74,9	148,6	130,4	55,3	8,2	9,6	10,0
>180	8,5	18,0	13,6	2,8	4,5	5,7	0,0
<b>Total</b>	<b>1552,9</b>	<b>1662,6</b>	<b>1123,1</b>	<b>958,3</b>	<b>162,5</b>	<b>217,6</b>	<b>377,0</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	7.44%		7.59%	6.71%	6.87%
15-35	7.49%		7.56%	7.37%	7.53%
36-60	7.47%		6.92%	7.47%	7.20%
61-90	-		7.49%	7.08%	7.47%
91-180	7.47%		7.55%	7.25%	7.44%
>180	-		7.12%	6.74%	6.91%
<b>Total</b>	<b>7.47%</b>		<b>7.48%</b>	<b>6.87%</b>	<b>7.24%</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>	36	96	4627	5391	95	164	5543	6587	32	224	3947	5461
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3583	2954	0	0	4433	2626	0	0	3841	1813
Otros <sup>c</sup>	96	36	272	136	164	95	347	592	224	32	527	1042
<b>Total</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>8482</b>	<b>8481</b>	<b>259</b>	<b>259</b>	<b>10323</b>	<b>9805</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>8315</b>	<b>8316</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.