

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de enero de 2024**  
**Fecha de Información: 09 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\$3918 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.38%<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	922,9	625,0	267,0	771,5	233,5	26,9	124,5
15-35	610,8	1369,6	1067,2	270,0	32,9	71,3	269,5
36-60	74,8	133,2	105,0	48,0	3,2	1,8	25,0
61-90	54,3	57,3	45,0	45,0	3,5	0,4	8,9
91-180	263,9	127,5	75,0	10,0	22,5	223,9	30,0
>180	103,5	68,4	33,0	50,8	0,4	17,7	35,0
<b>Total</b>	<b>2030,3</b>	<b>2380,9</b>	<b>1592,2</b>	<b>1195,3</b>	<b>295,9</b>	<b>342,1</b>	<b>492,9</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	8.11%		5.19%	7.64%	6.96%
15-35	7.87%		7.91%	6.61%	7.70%
36-60	7.50%		5.87%	7.24%	6.98%
61-90	7.35%		7.79%	7.07%	7.46%
91-180	7.38%		9.50%	7.18%	7.65%
>180	7.24%		7.28%	5.59%	6.79%
<b>Total</b>	<b>7.83%</b>		<b>7.29%</b>	<b>7.30%</b>	<b>7.38%</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	08 – 12 ene.				15 - 19 ene.				22 - 26 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	100	161	6819	7254	35	230	4245	5786	41	235	3498	4583
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4664	3681	0	0	4104	2043	0	0	2696	1210
Otros <sup>c</sup>	161	100	579	608	230	35	543	1063	235	41	571	969
<b>Total</b>	<b>261</b>	<b>261</b>	<b>12062</b>	<b>11543</b>	<b>265</b>	<b>265</b>	<b>8892</b>	<b>8892</b>	<b>276</b>	<b>276</b>	<b>6765</b>	<b>6762</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.