

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de enero de 2024**

**Fecha de Información: 10 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\$2502 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.32%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	543,5	271,7	146,0	441,6	0,0	26,0	75,8
15-35	704,0	1014,6	590,9	218,0	29,0	91,2	394,8
36-60	68,2	135,2	83,5	30,0	16,7	3,2	35,0
61-90	4,6	7,5	0,0	0,5	6,5	3,1	1,0
91-180	52,3	24,7	0,0	35,0	9,7	2,3	15,0
>180	75,5	157,0	120,0	20,0	2,0	20,5	35,0
<b>Total</b>	<b>1448,0</b>	<b>1610,8</b>	<b>940,4</b>	<b>745,1</b>	<b>63,9</b>	<b>146,2</b>	<b>556,6</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	7.43%		5.24%	7.53%	7.07%
15-35	7.51%		7.58%	7.38%	7.51%
36-60	7.13%		7.49%	7.25%	7.38%
61-90	7.15%		7.46%	7.06%	7.31%
91-180	7.11%		7.37%	7.04%	7.20%
>180	6.90%		6.60%	6.18%	6.58%
<b>Total</b>	<b>7.42%</b>		<b>7.17%</b>	<b>7.39%</b>	<b>7.32%</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

Sector	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>	96	128	5949	5928	37	263	4288	5817	42	242	3561	4672
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3781	3201	1	0	4126	2078	0	0	2763	1249
Otros <sup>c</sup>	128	96	459	549	262	37	547	1067	242	42	581	981
<b>Total</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>10189</b>	<b>9678</b>	<b>300</b>	<b>300</b>	<b>8961</b>	<b>8962</b>	<b>284</b>	<b>284</b>	<b>6905</b>	<b>6902</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.