

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de enero de 2024**  
**Fecha de Información: 11 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\$4291 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.62%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	359,7	732,3	138,0	303,3	569,3	31,4	25
15-35	946,2	901,7	528,2	570,0	26,4	29,2	347
36-60	18,7	61,3	45,0	0,0	16,3	18,7	0
61-90	220,4	134,7	85,0	175,0	4,7	0,4	45
91-180	688,3	635,4	525,2	15,0	15,2	578,3	95
>180	40,0	98,7	54,0	4,7	9,7	0,3	35
<b>Total</b>	<b>2273,4</b>	<b>2564,1</b>	<b>1375,5</b>	<b>1068,1</b>	<b>641,6</b>	<b>658,4</b>	<b>547</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%	4.82%	7.37%	5.58%
15-35	7.50%	7.05%	6.72%	7.10%
36-60	–	7.43%	7.21%	7.38%
61-90	7.28%	7.30%	7.28%	7.29%
91-180	7.10%	7.13%	6.83%	6.92%
>180	7.09%	7.03%	6.73%	7.06%
<b>Total</b>	<b>7.39%</b>	<b>6.08%</b>	<b>6.92%</b>	<b>6.62%</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>	80	98	4195	4286	39	262	5089	6866	46	247	3784	4861
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2634	2397	1	0	4371	2597	0	0	2821	1379
Otros <sup>c</sup>	98	80	381	522	261	39	1113	1111	247	46	622	984
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>7210</b>	<b>7205</b>	<b>301</b>	<b>301</b>	<b>10573</b>	<b>10574</b>	<b>293</b>	<b>293</b>	<b>7227</b>	<b>7224</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.