

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 17 de enero de 2024**

**Fecha de Información: 15 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\$591 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.85%<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	168,5	60,2	2,0	120	17,2	7,5	41
15-35	87,3	328,7	260,7	16	2,0	5,3	66
36-60	2,0	4,1	0,0	0	4,1	2,0	0
61-90	0,3	1,4	0,0	0	1,4	0,3	0
91-180	0,5	14,7	0,0	0	14,7	0,5	0
>180	3,2	27,6	0,0	0	27,6	3,2	0
<b>Total</b>	<b>261,8</b>	<b>436,6</b>	<b>262,7</b>	<b>136</b>	<b>67,0</b>	<b>18,8</b>	<b>107</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	2.47%		2.49%	0.74%	1.30%
15-35	7.36%		7.32%	6.92%	7.32%
36-60	-		7.77%	6.95%	7.50%
61-90	-		7.55%	7.06%	7.47%
91-180	-		7.36%	7.12%	7.35%
>180	-		7.19%	6.32%	7.10%
<b>Total</b>	<b>5.48%</b>		<b>6.88%</b>	<b>1.23%</b>	<b>4.85%</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	15 – 19 ene.				22 - 26 ene.				29 ene. - 02 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	40	273	5240	6894	46	248	3800	4881	27	185	4943	5150
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	4373	2717	0	0	2821	1379	0	0	3531	2578
Otros <sup>c</sup>	272	40	1114	1116	248	46	627	985	185	27	576	1322
<b>Total</b>	<b>313</b>	<b>313</b>	<b>10727</b>	<b>10727</b>	<b>294</b>	<b>294</b>	<b>7248</b>	<b>7245</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>9050</b>	<b>9050</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.