

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de enero de 2024**  
**Fecha de Información: 25 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\$4021 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.68%<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	551,1	589,8	172,0	325,0	216,8	25,1	201,0
15-35	901,7	955,6	655,0	578,2	4,7	27,6	295,9
36-60	334,0	245,4	208,5	265,0	6,9	39,0	30,0
61-90	23,3	4,5	0,0	10,0	4,5	13,3	0,0
91-180	338,4	593,5	469,6	0,0	23,9	238,4	100,0
>180	77,7	42,8	30,5	30,5	2,3	37,2	10,0
<b>Total</b>	<b>2226,1</b>	<b>2431,6</b>	<b>1535,6</b>	<b>1208,7</b>	<b>259,1</b>	<b>380,5</b>	<b>636,9</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	7.70%		7.98%	7.81%	7.85%
15-35	7.84%		7.96%	7.79%	7.85%
36-60	7.77%		7.74%	7.66%	7.72%
61-90	-		7.90%	7.36%	7.50%
91-180	7.42%		7.45%	7.29%	7.39%
>180	6.75%		6.91%	6.74%	6.79%
<b>Total</b>	<b>7.71%</b>		<b>7.73%</b>	<b>7.59%</b>	<b>7.68%</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	22 – 26 ene.				29 ene. - 02 feb.				05 - 09 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	12	138	3158	3515	38	191	6019	7198	50	111	4746	5778
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1785	1406	0	0	4446	3119	0	0	3597	2076
Otros <sup>c</sup>	138	12	530	547	191	38	1292	1439	111	50	601	1046
<b>Total</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>5473</b>	<b>5468</b>	<b>229</b>	<b>229</b>	<b>11757</b>	<b>11756</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>8944</b>	<b>8900</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.