

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2023**

**Fecha de Información: 14 de noviembre de 2023<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\$5515 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.49%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	808,4	1250,3	725,3	493,7	233,0	22,7	292,0
15-35	1087,6	1319,0	665,3	443,0	60,3	51,1	593,5
36-60	228,3	222,3	35,0	75,5	37,3	2,8	150,0
61-90	279,7	35,1	0,0	0,0	34,1	278,7	1,0
91-180	242,4	303,4	79,5	35,0	58,6	42,1	165,3
>180	785,2	395,8	144,8	543,5	9,6	0,3	241,4
<b>Total</b>	<b>3431,7</b>	<b>3526,0</b>	<b>1649,9</b>	<b>1590,7</b>	<b>432,9</b>	<b>397,8</b>	<b>1443,2</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	9.11%	8.55%	8.09%	8.53%
15-35	8.87%	8.59%	8.63%	8.71%
36-60	8.69%	8.80%	8.32%	8.72%
61-90	8.45%	8.99%	8.45%	8.51%
91-180	8.52%	8.54%	8.40%	8.51%
>180	8.05%	7.83%	7.95%	7.96%
<b>Total</b>	<b>8.72%</b>	<b>8.52%</b>	<b>8.26%</b>	<b>8.49%</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	13 – 17 nov.				20 - 24 nov.				27 nov. - 01 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	188	192	8394	9156	34	256	7121	8427	175	294	5527	6436
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4398	3462	0	0	5501	3742	0	0	3503	2199
Otros <sup>c</sup>	192	188	1826	1997	256	34	780	1227	294	175	741	1136
<b>Total</b>	<b>380</b>	<b>380</b>	<b>14618</b>	<b>14615</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>13402</b>	<b>13396</b>	<b>469</b>	<b>469</b>	<b>9771</b>	<b>9771</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.