

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de diciembre de 2023**  
**Fecha de Información: 01 de diciembre 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\$3170 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.75%<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	686,2	808,0	558,4	570,2	170,8	37,2	78,8
15-35	623,6	598,9	410,9	444,0	23,0	14,6	165,0
36-60	11,2	44,5	12,8	0,0	22,7	2,2	9,0
61-90	38,2	13,0	0,0	0,0	13,0	38,2	0,0
91-180	175,0	123,4	80,0	0,0	38,4	170,0	5,0
>180	39,0	287,4	245,0	19,0	22,4	0,0	20,0
<b>Total</b>	<b>1573,2</b>	<b>1875,1</b>	<b>1307,0</b>	<b>1033,2</b>	<b>290,3</b>	<b>262,2</b>	<b>277,8</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	8.55%		7.72%	5.52%	7.08%
15-35	8.21%		8.33%	8.28%	8.28%
36-60	8.15%		8.15%	7.50%	8.11%
61-90	-		8.53%	7.31%	7.62%
91-180	7.76%		7.84%	7.56%	7.68%
>180	7.57%		7.60%	-	7.60%
<b>Total</b>	<b>8.25%</b>		<b>7.90%</b>	<b>7.38%</b>	<b>7.75%</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	27 nov. - 01 dic.				04 - 08 dic.				11 - 15 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	26	14	319	671	46	202	6605	8486	113	174	7164	8887
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	439	71	0	0	5850	3984	0	0	5446	3693
Otros <sup>c</sup>	14	26	53	70	202	46	723	702	174	113	615	606
<b>Total</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>811</b>	<b>812</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>13178</b>	<b>13172</b>	<b>287</b>	<b>287</b>	<b>13225</b>	<b>13186</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.