

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2023**  
**Fecha de Información: 12 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\$3730 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.74%<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	847,7	429,4	196,4	717,6	218,2	115,2	14,8
15-35	716,2	1361,3	1060,3	443,3	44,0	15,9	257,0
36-60	69,7	36,7	1,0	50,0	27,7	11,7	8,0
61-90	99,2	42,8	2,0	60,0	20,8	19,2	20,0
91-180	49,4	98,8	78,0	25,0	20,8	24,4	0,0
>180	146,5	166,7	130,0	45,7	1,7	65,8	35,0
<b>Total</b>	<b>1928,7</b>	<b>2135,7</b>	<b>1467,6</b>	<b>1341,6</b>	<b>333,2</b>	<b>252,2</b>	<b>334,8</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	8.82%		9.43%	7.70%	8.30%
15-35	8.90%		7.57%	6.46%	7.51%
36-60	8.65%		8.49%	8.08%	8.42%
61-90	8.12%		8.08%	7.96%	8.01%
91-180	-		7.78%	7.58%	7.72%
>180	6.95%		7.12%	6.99%	7.04%
<b>Total</b>	<b>8.64%</b>		<b>7.95%</b>	<b>7.20%</b>	<b>7.74%</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	11 – 15 dic.				18 - 22 dic.				25 - 29 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	74	143	9058	9179	47	385	9048	11917	21	244	2511	3521
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5334	5462	0	0	7451	4835	0	0	2056	1414
Otros <sup>c</sup>	143	74	936	656	385	47	1429	1175	244	21	684	316
<b>Total</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>15328</b>	<b>15297</b>	<b>432</b>	<b>432</b>	<b>17928</b>	<b>17927</b>	<b>265</b>	<b>265</b>	<b>5251</b>	<b>5251</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.