

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2023**  
**Fecha de Información: 13 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\$3311 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.82%<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	512,4	529,3	305,6	419,2	141,7	11,2	82
15-35	532,6	647,8	455,5	386,5	64,3	18,1	128
36-60	174,6	317,0	14,0	0,0	213,0	84,6	90
61-90	127,1	59,7	35,0	0,0	14,7	117,1	10
91-180	80,9	84,5	49,2	35,0	35,3	45,9	0
>180	282,8	287,5	272,0	54,2	0,6	213,6	15
<b>Total</b>	<b>1710,4</b>	<b>1925,8</b>	<b>1131,3</b>	<b>894,9</b>	<b>469,6</b>	<b>490,5</b>	<b>325</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	9.25%		4.69%	7.82%	6.63%
15-35	8.80%		8.67%	8.70%	8.70%
36-60	8.31%		7.96%	8.10%	8.07%
61-90	8.00%		7.80%	7.67%	7.73%
91-180	-		12.21%	7.45%	8.90%
>180	6.96%		7.45%	7.31%	7.34%
<b>Total</b>	<b>8.67%</b>		<b>7.56%</b>	<b>7.84%</b>	<b>7.82%</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>	64	126	6162	6024	50	511	9282	12129	22	243	2537	3533
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3586	3704	0	0	7622	5036	0	0	2056	1438
Otros <sup>c</sup>	126	64	567	558	511	50	1439	1178	243	22	696	318
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>10315</b>	<b>10286</b>	<b>561</b>	<b>561</b>	<b>18343</b>	<b>18343</b>	<b>265</b>	<b>265</b>	<b>5289</b>	<b>5289</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.