

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 20 de octubre 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\$2625 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.60%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	724,4	630,7	350,7	523,6	103,7	24,5	176,3
15-35	630,7	814,4	430,8	174,5	22,6	95,2	361,0
36-60	36,6	4,2	0,0	0,0	4,2	36,6	0,0
61-90	15,7	69,2	45,0	0,0	9,2	0,7	15,0
91-180	87,9	44,6	0,0	60,0	29,6	12,9	15,0
>180	96,6	77,2	28,0	56,6	9,2	0,0	40,0
<b>Total</b>	<b>1591,9</b>	<b>1640,3</b>	<b>854,5</b>	<b>814,8</b>	<b>178,5</b>	<b>169,9</b>	<b>607,3</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	11.83%	11.90%	11.72%	11.80%
15-35	12.26%	12.22%	10.99%	11.94%
36-60	–	11.82%	11.52%	11.55%
61-90	11.02%	9.57%	10.60%	9.94%
91-180	10.34%	10.53%	10.14%	10.29%
>180	8.98%	9.26%	9.52%	9.28%
<b>Total</b>	<b>11.84%</b>	<b>11.82%</b>	<b>11.16%</b>	<b>11.60%</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	16 – 20 oct.				23 - 27 oct.				30 oct. - 03 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	16	41	1069	975	157	248	7748	9303	68	300	6322	7938
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	596	710	0	0	5329	3577	0	0	4586	2100
Otros <sup>c</sup>	41	16	69	49	248	157	1291	1481	300	68	928	1798
<b>Total</b>	<b>57</b>	<b>57</b>	<b>1734</b>	<b>1734</b>	<b>405</b>	<b>405</b>	<b>14368</b>	<b>14361</b>	<b>368</b>	<b>368</b>	<b>11836</b>	<b>11836</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.