

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 23 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\$2917 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.37%<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	452,4	684,2	359,6	342,1	233,6	19,3	91
15-35	720,7	799,9	395,4	334,8	85,6	66,9	319
36-60	343,0	59,1	20,0	0,0	9,1	313,0	30
61-90	0,4	9,4	0,2	0,0	9,2	0,4	0
91-180	82,7	111,4	100,0	60,0	11,4	22,7	0
>180	10,2	83,2	81,0	10,0	2,2	0,2	0
<b>Total</b>	<b>1609,4</b>	<b>1747,3</b>	<b>956,2</b>	<b>746,9</b>	<b>351,1</b>	<b>422,4</b>	<b>440</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	11.93%	10.29%	11.46%	10.81%
15-35	12.17%	11.94%	11.94%	12.00%
36-60	11.85%	11.37%	11.11%	11.19%
61-90	–	10.73%	11.19%	10.74%
91-180	–	10.40%	10.20%	10.33%
>180	–	9.28%	9.59%	9.32%
<b>Total</b>	<b>12.10%</b>	<b>10.98%</b>	<b>11.43%</b>	<b>11.37%</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	23 – 27 oct.				30 oct. - 03 nov.				06 - 10 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	159	254	8125	9686	77	304	6508	8237	31	92	7206	7159
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5642	3784	0	0	4637	2253	0	0	4380	2878
Otros <sup>c</sup>	254	159	1294	1584	304	77	1150	1805	92	31	364	1364
<b>Total</b>	<b>413</b>	<b>413</b>	<b>15061</b>	<b>15054</b>	<b>381</b>	<b>381</b>	<b>12295</b>	<b>12295</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>11950</b>	<b>11401</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.