

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de noviembre de 2023**  
**Fecha de Información: 30 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\$3536 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.18%<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	722,2	836,4	197,5	528,3	475,9	31,0	163
15-35	513,5	719,2	252,0	226,6	225,2	44,9	242
36-60	80,0	326,0	250,0	11,2	36,0	28,8	40
61-90	6,4	40,5	22,5	0,0	18,0	6,4	0
91-180	483,2	109,7	90,0	19,0	19,7	464,2	0
>180	99,4	54,2	33,0	66,8	11,2	22,7	10
<b>Total</b>	<b>1904,8</b>	<b>2086,0</b>	<b>845,0</b>	<b>851,9</b>	<b>786,0</b>	<b>597,9</b>	<b>455</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	9.17%	5.69%	7.04%	6.71%
15-35	9.17%	9.48%	9.13%	9.30%
36-60	9.23%	8.53%	9.26%	8.72%
61-90	–	9.33%	9.35%	9.33%
91-180	–	9.14%	8.66%	8.75%
>180	8.66%	8.91%	8.22%	8.41%
<b>Total</b>	<b>9.16%</b>	<b>7.82%</b>	<b>8.20%</b>	<b>8.18%</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	30 oct. - 03 nov.				06 - 10 nov.				13 - 17 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	92	327	8754	10291	36	100	7797	8159	112	176	5131	6042
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5397	3702	0	0	4522	3293	0	0	3294	1779
Otros <sup>c</sup>	327	92	1881	2039	100	36	1080	1399	176	112	1090	1692
<b>Total</b>	<b>419</b>	<b>419</b>	<b>16032</b>	<b>16032</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>13399</b>	<b>12851</b>	<b>288</b>	<b>288</b>	<b>9515</b>	<b>9513</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.