

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de noviembre de 2023**

**Fecha de Información: 03 de noviembre 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\$3929 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.41%<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	817,7	939,3	504,0	615,5	333,3	100,2	102,0
15-35	751,9	808,9	406,8	471,7	144,6	22,6	257,5
36-60	17,9	61,9	0,0	15,9	61,9	2,0	0,0
61-90	31,6	239,7	105,1	0,0	104,6	1,6	30,0
91-180	350,7	168,4	40,3	0,0	78,1	300,7	50,0
>180	87,2	122,8	82,0	25,6	10,8	31,6	30,0
<b>Total</b>	<b>2057,0</b>	<b>2341,0</b>	<b>1138,2</b>	<b>1128,7</b>	<b>733,3</b>	<b>458,8</b>	<b>469,5</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	8.89%		9.00%	6.91%	8.16%
15-35	8.92%		8.89%	7.88%	8.58%
36-60	-		9.55%	8.75%	9.37%
61-90	8.86%		7.94%	8.81%	8.07%
91-180	8.76%		8.86%	8.64%	8.71%
>180	8.40%		8.53%	7.67%	8.09%
<b>Total</b>	<b>8.86%</b>		<b>8.84%</b>	<b>7.69%</b>	<b>8.41%</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	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>	9	81	1013	1198	45	121	9924	10816	131	184	6380	7343
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	528	313	0	0	5382	3757	0	0	3588	2360
Otros <sup>c</sup>	81	9	267	296	121	45	1319	1504	184	131	1465	1728
<b>Total</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>1808</b>	<b>1807</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>16625</b>	<b>16077</b>	<b>315</b>	<b>315</b>	<b>11433</b>	<b>11431</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.