

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2023**

**Fecha de Información: 09 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\$4447 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.08%<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	986,0	832,0	488,9	707,5	164,0	99,5	179,0
15-35	837,7	1148,7	689,9	436,4	106,8	49,4	351,9
36-60	245,4	153,3	92,0	40,8	16,3	159,6	45,0
61-90	355,7	100,9	50,0	183,5	14,9	136,2	36,0
91-180	47,0	221,6	178,0	0,0	23,6	27,0	20,0
>180	48,7	107,0	101,8	38,5	0,3	5,2	5,0
<b>Total</b>	<b>2520,5</b>	<b>2563,5</b>	<b>1600,6</b>	<b>1406,7</b>	<b>325,9</b>	<b>476,9</b>	<b>636,9</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	9.45%	9.72%	8.07%	8.76%
15-35	9.64%	9.56%	9.03%	9.43%
36-60	9.44%	7.95%	9.63%	9.02%
61-90	8.96%	9.16%	8.91%	8.97%
91-180	8.77%	8.81%	8.68%	8.79%
>180	8.53%	8.32%	8.01%	8.25%
<b>Total</b>	<b>9.50%</b>	<b>9.29%</b>	<b>8.68%</b>	<b>9.08%</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	06 – 10 nov.				13 - 17 nov.				20 - 24 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	18	54	6253	6700	160	188	7565	8520	29	245	6538	7382
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3909	3312	0	0	4072	3018	0	0	4883	3392
Otros <sup>c</sup>	54	18	384	506	188	160	1744	1841	245	29	560	1200
<b>Total</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>10546</b>	<b>10518</b>	<b>348</b>	<b>348</b>	<b>13381</b>	<b>13379</b>	<b>274</b>	<b>274</b>	<b>11981</b>	<b>11974</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.