

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2023**  
**Fecha de Información: 10 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\$3121 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.38%<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	765,9	833,8	493,0	446,0	90,2	0,0	319,9
15-35	605,4	746,4	446,8	297,1	20,7	29,3	279,0
36-60	0,7	6,7	0,0	0,0	6,7	0,7	0,0
61-90	75,9	35,6	0,0	0,0	15,6	55,9	20,0
91-180	75,2	33,0	10,0	0,0	23,0	75,2	0,0
>180	480,3	425,5	80,0	135,0	0,5	0,3	345,0
<b>Total</b>	<b>2003,4</b>	<b>2081,1</b>	<b>1029,8</b>	<b>878,1</b>	<b>156,7</b>	<b>161,4</b>	<b>963,9</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	9.35%		8.63%	6.56%	7.95%
15-35	9.12%		9.17%	8.26%	9.00%
36-60	-		9.31%	8.86%	9.27%
61-90	8.65%		8.99%	8.56%	8.65%
91-180	-		8.91%	8.64%	8.73%
>180	8.26%		7.98%	8.02%	8.19%
<b>Total</b>	<b>8.84%</b>		<b>8.87%</b>	<b>7.38%</b>	<b>8.38%</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>	9	22	1266	1414	183	190	7879	8906	32	245	6782	7616
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1059	891	0	0	4335	3243	0	0	4983	3502
Otros <sup>c</sup>	22	9	28	47	190	183	1823	1885	245	32	570	1210
<b>Total</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>2353</b>	<b>2352</b>	<b>373</b>	<b>373</b>	<b>14037</b>	<b>14034</b>	<b>277</b>	<b>277</b>	<b>12335</b>	<b>12328</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.