

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2023**  
**Fecha de Información: 23 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\$236 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.92%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	14,4	11,4	0,0	0	1,4	4,4	10
15-35	202,7	159,9	0,0	44	4,9	3,7	155
36-60	0,0	0,1	0,0	0	0,1	0,0	0
61-90	0,3	9,5	0,0	0	9,5	0,3	0
91-180	0,1	2,3	0,1	0	2,2	0,1	0
>180	0,0	0,0	0,0	0	0,0	0,0	0
<b>Total</b>	<b>217,4</b>	<b>183,2</b>	<b>0,1</b>	<b>44</b>	<b>18,1</b>	<b>8,4</b>	<b>165</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	7.96%	11.52%	8.67%	8.47%
15-35	8.43%	9.17%	5.78%	7.84%
36-60	–	8.88%	8.00%	8.74%
61-90	–	8.53%	8.23%	8.52%
91-180	–	8.42%	8.33%	8.42%
>180	–	8.55%	–	8.55%
<b>Total</b>	<b>8.40%</b>	<b>8.92%</b>	<b>6.04%</b>	<b>7.92%</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	20 – 24 nov.				27 nov. - 01 dic.				04 - 08 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	22	166	922	1116	191	287	7126	8919	21	188	4736	6461
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	796	613	0	0	4385	2838	0	0	4694	2592
Otros <sup>c</sup>	166	22	104	87	287	191	1472	1227	188	21	294	666
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>1822</b>	<b>1816</b>	<b>478</b>	<b>478</b>	<b>12983</b>	<b>12984</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>9724</b>	<b>9719</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.