

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 03 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\$3374 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.77%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupa y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	627,0	590,4	252,7	387,9	201,2	102,6	136,5
15-35	841,7	1375,5	683,3	258,2	142,2	33,5	550,0
36-60	272,7	46,5	25,0	50,0	6,5	207,7	15,0
61-90	16,9	124,5	121,9	2,5	2,6	14,4	0,0
91-180	56,1	30,1	10,0	26,2	10,1	19,9	10,0
>180	82,7	31,4	14,5	16,7	6,9	56,0	10,0
<b>Total</b>	<b>1897,1</b>	<b>2198,4</b>	<b>1107,4</b>	<b>741,5</b>	<b>369,5</b>	<b>434,1</b>	<b>721,5</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	10.36%		10.44%	9.27%	9.93%
15-35	10.32%		9.70%	8.94%	9.80%
36-60	9.91%		10.03%	9.88%	9.89%
61-90	-		9.64%	9.37%	9.59%
91-180	9.24%		9.27%	9.06%	9.15%
>180	7.97%		7.88%	7.91%	7.91%
<b>Total</b>	<b>10.27%</b>		<b>9.89%</b>	<b>9.26%</b>	<b>9.77%</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	02 – 06 oct.				09 - 13 oct.				16 - 20 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	75	94	7689	8613	142	134	7289	8418	44	131	5878	6499
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4954	3819	0	0	4555	2732	0	0	3024	1489
Otros <sup>c</sup>	94	75	1392	1589	134	142	1251	1410	131	44	462	1375
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>14035</b>	<b>14021</b>	<b>276</b>	<b>276</b>	<b>13095</b>	<b>12560</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>9364</b>	<b>9363</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.