

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 04 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\$4094 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.11%<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	945,3	684,5	302,7	698,5	171,1	36,1	210,7
15-35	767,0	1786,8	1257,8	264,4	0,0	47,1	455,5
36-60	291,3	159,0	100,0	94,5	9,0	146,8	50,0
61-90	115,1	37,8	20,0	37,2	12,8	0,0	77,9
91-180	31,5	19,4	10,0	5,0	9,4	26,5	0,0
>180	37,5	13,3	12,9	0,0	0,4	37,5	0,0
<b>Total</b>	<b>2187,7</b>	<b>2700,8</b>	<b>1703,4</b>	<b>1099,6</b>	<b>202,6</b>	<b>294,0</b>	<b>794,1</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	10.75%	10.32%	8.61%	9.37%
15-35	10.76%	10.60%	10.52%	10.64%
36-60	10.03%	10.10%	10.28%	10.18%
61-90	9.96%	9.93%	9.68%	9.72%
91-180	–	9.35%	8.86%	8.97%
>180	–	8.52%	8.16%	8.26%
<b>Total</b>	<b>10.70%</b>	<b>10.50%</b>	<b>9.15%</b>	<b>10.11%</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	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>	74	82	7164	7725	144	134	7570	8862	46	131	5905	6518
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4332	3476	0	0	4771	2947	0	0	3027	1490
Otros <sup>c</sup>	82	74	1271	1552	134	144	1419	1415	131	46	462	1385
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>12767</b>	<b>12753</b>	<b>278</b>	<b>278</b>	<b>13760</b>	<b>13224</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>9394</b>	<b>9393</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.