

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 09 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\$618 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.14%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,3	46,4	32	28	4,4	16,3	10
15-35	44,2	55,6	21	9	4,6	5,2	30
36-60	1,4	25,3	0	0	25,3	1,4	0
61-90	2,9	16,7	11	0	5,7	2,9	0
91-180	107,9	104,5	0	0	5,5	8,9	99
>180	297,6	297,5	0	0	0,5	0,6	297
<b>Total</b>	<b>508,2</b>	<b>545,9</b>	<b>64</b>	<b>37</b>	<b>45,9</b>	<b>35,2</b>	<b>436</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	11.01%		12.36%	10.12%	10.86%
15-35	11.30%		12.26%	11.75%	11.67%
36-60	-		11.03%	10.03%	10.98%
61-90	-		10.56%	10.39%	10.50%
91-180	9.09%		5.60%	9.68%	8.97%
>180	8.27%		9.03%	7.27%	8.27%
<b>Total</b>	<b>8.73%</b>		<b>11.02%</b>	<b>10.51%</b>	<b>9.14%</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	09 – 13 oct.				16 - 20 oct.				23 - 27 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	172	144	8209	9522	56	135	6045	6775	72	235	6207	6731
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5011	3394	0	0	3201	1540	0	0	4197	2681
Otros <sup>c</sup>	144	172	1691	1459	135	56	470	1399	235	72	409	1394
<b>Total</b>	<b>316</b>	<b>316</b>	<b>14911</b>	<b>14375</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>9716</b>	<b>9714</b>	<b>307</b>	<b>307</b>	<b>10813</b>	<b>10806</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.