

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 11 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\$3917 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.25%<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	647,0	826,0	241,5	485,7	430,0	6,8	154,5
15-35	1231,5	858,3	456,2	446,4	60,1	443,1	342,0
36-60	149,4	114,3	80,0	35,0	4,3	84,4	30,0
61-90	53,1	82,0	52,0	30,0	12,9	6,0	17,1
91-180	35,7	164,2	143,0	12,8	11,2	12,9	10,0
>180	248,9	290,6	60,0	8,1	0,6	10,8	230,0
<b>Total</b>	<b>2365,5</b>	<b>2335,4</b>	<b>1032,7</b>	<b>1018,0</b>	<b>519,2</b>	<b>564,0</b>	<b>783,6</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	12.06%	10.89%	11.93%	11.40%
15-35	12.02%	12.11%	11.65%	11.86%
36-60	9.65%	10.58%	11.33%	10.76%
61-90	10.69%	10.67%	10.36%	10.64%
91-180	10.06%	9.99%	9.65%	9.94%
>180	8.36%	8.14%	8.09%	8.33%
<b>Total</b>	<b>10.81%</b>	<b>11.14%</b>	<b>11.62%</b>	<b>11.25%</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>	158	102	7745	7915	59	137	6344	7698	73	234	6395	7061
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3806	3367	0	0	3433	1659	0	0	4343	2764
Otros <sup>c</sup>	102	158	1480	1215	137	59	988	1406	234	73	504	1409
<b>Total</b>	<b>260</b>	<b>260</b>	<b>13031</b>	<b>12497</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>10765</b>	<b>10763</b>	<b>307</b>	<b>307</b>	<b>11242</b>	<b>11234</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.