

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de noviembre de 2023**  
**Fecha de Información: 22 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\$5012 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.48%<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	718,9	751,3	380,8	406,6	96,5	38,3	274,0
15-35	1155,7	1453,2	588,8	511,0	253,1	33,4	611,3
36-60	104,7	103,7	0,0	0,0	3,7	4,7	100,0
61-90	266,7	443,8	428,0	217,0	5,8	39,7	10,0
91-180	431,5	472,4	332,5	37,6	34,9	289,0	105,0
>180	77,1	138,8	131,5	64,8	1,3	6,3	6,0
<b>Total</b>	<b>2754,5</b>	<b>3363,3</b>	<b>1861,6</b>	<b>1236,9</b>	<b>395,4</b>	<b>411,4</b>	<b>1106,2</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	8.96%	7.67%	6.47%	7.80%
15-35	8.78%	6.43%	6.79%	7.30%
36-60	8.68%	8.86%	8.39%	8.67%
61-90	8.42%	6.93%	8.12%	7.12%
91-180	8.12%	7.96%	7.21%	7.60%
>180	6.87%	8.01%	6.91%	7.73%
<b>Total</b>	<b>8.74%</b>	<b>6.97%</b>	<b>6.91%</b>	<b>7.48%</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>	34	213	5875	6612	190	287	7123	8918	20	188	4725	6450
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4124	3638	0	0	4385	2838	0	0	4694	2592
Otros <sup>c</sup>	213	34	1111	854	287	190	1472	1224	188	20	294	665
<b>Total</b>	<b>247</b>	<b>247</b>	<b>11110</b>	<b>11104</b>	<b>477</b>	<b>477</b>	<b>12980</b>	<b>12980</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>9713</b>	<b>9707</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.