

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2023**  
**Fecha de Información: 27 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\$3294 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.93%<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	772,4	720,2	524,8	573,8	127,1	130,3	68,3
15-35	589,9	806,9	485,1	399,3	156,1	24,9	165,7
36-60	96,3	80,3	30,0	82,0	40,3	4,3	10,0
61-90	3,2	24,6	9,4	0,0	15,2	3,2	0,0
91-180	214,5	222,2	155,8	75,0	44,4	117,5	22,0
>180	13,0	16,3	10,0	13,0	6,3	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>1689,2</b>	<b>1870,4</b>	<b>1215,1</b>	<b>1143,1</b>	<b>389,4</b>	<b>280,1</b>	<b>266,0</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%	8.79%	7.04%	7.78%
15-35	8.43%	7.65%	8.33%	8.01%
36-60	7.88%	8.25%	7.83%	8.04%
61-90	–	8.46%	7.99%	8.38%
91-180	7.89%	7.94%	7.85%	7.90%
>180	–	7.78%	–	7.78%
<b>Total</b>	<b>8.50%</b>	<b>7.98%</b>	<b>7.70%</b>	<b>7.93%</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	27 nov. - 01 dic.				04 - 08 dic.				11 - 15 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	193	291	8257	9546	24	191	5052	6908	63	168	6725	8121
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4922	3695	0	0	4957	2835	0	0	5067	3479
Otros <sup>c</sup>	291	193	1518	1456	191	24	408	669	168	63	416	568
<b>Total</b>	<b>484</b>	<b>484</b>	<b>14697</b>	<b>14697</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>10417</b>	<b>10412</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>12208</b>	<b>12168</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.