

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 02 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 28 de septiembre 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\$3286 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.35%<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	920,7	760,9	312,5	566,8	113,4	18,9	335
15-35	917,9	1039,5	602,5	378,8	86,1	188,1	351
36-60	9,3	17,8	11,0	0,0	6,8	9,3	0
61-90	33,8	77,7	60,0	7,2	17,7	26,5	0
91-180	51,9	84,8	0,0	0,0	34,8	1,9	50
>180	78,6	99,1	15,0	4,5	14,1	4,1	70
<b>Total</b>	<b>2012,1</b>	<b>2079,8</b>	<b>1001,0</b>	<b>957,3</b>	<b>272,8</b>	<b>248,8</b>	<b>806</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	10.90%		10.26%	9.69%	10.30%
15-35	10.73%		10.61%	10.70%	10.68%
36-60	—		10.22%	10.09%	10.18%
61-90	—		9.97%	9.76%	9.83%
91-180	9.02%		9.26%	8.92%	9.11%
>180	8.31%		8.00%	8.27%	8.23%
<b>Total</b>	<b>10.48%</b>		<b>10.33%</b>	<b>10.22%</b>	<b>10.35%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{365/\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	25 – 29 sept.				02 - 06 oct.				09 - 13 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	22	149	3959	3924	93	105	7564	9051	95	132	6327	6848
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	1661	1782	0	0	5107	3309	0	0	4365	2401
Otros <sup>c</sup>	148	22	1309	1202	105	93	1541	1839	132	95	488	1395
<b>Total</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>6929</b>	<b>6908</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>14212</b>	<b>14199</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>11180</b>	<b>10644</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.