

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 29 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\$3464 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.45%<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	757,9	1154,9	246,5	333,4	513,4	29,5	395,0
15-35	882,2	934,4	243,3	179,5	157,6	169,2	533,5
36-60	1,0	17,5	0,0	0,0	17,5	1,0	0,0
61-90	109,8	158,3	40,0	0,0	13,3	4,8	105,0
91-180	344,7	26,2	0,3	0,0	25,9	344,7	0,0
>180	35,5	94,1	71,8	16,0	3,3	0,5	19,0
<b>Total</b>	<b>2131,0</b>	<b>2385,4</b>	<b>601,9</b>	<b>528,9</b>	<b>731,0</b>	<b>549,6</b>	<b>1052,5</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14		10.64%		7.06%	9.72%
15-35		10.59%		10.91%	10.60%
36-60		—		10.22%	9.56%
61-90		9.65%		10.00%	9.20%
91-180		—		9.46%	8.58%
>180		7.76%		7.59%	7.93%
<b>Total</b>		<b>10.46%</b>		<b>8.34%</b>	<b>9.52%</b>
					<b>9.45%</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	25 – 29 sep.				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>	16	49	861	830	96	109	8075	9575	112	132	6485	7384
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	250	478	0	0	5298	3639	0	0	4400	2404
Otros <sup>c</sup>	48	16	411	202	109	96	1701	1846	132	112	837	1398
<b>Total</b>	<b>65</b>	<b>65</b>	<b>1522</b>	<b>1510</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>15074</b>	<b>15060</b>	<b>244</b>	<b>244</b>	<b>11722</b>	<b>11186</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.