

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 09 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 05 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\$4180 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.64%<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	837,0	522,0	201,0	571,9	103,0	47,1	218
15-35	987,6	1543,0	981,6	368,6	61,4	119,0	500
36-60	127,8	26,9	9,0	20,0	12,9	102,8	5
61-90	29,1	58,4	55,2	0,0	3,2	29,1	0
91-180	330,5	420,9	127,8	39,3	15,1	13,2	278
>180	194,1	273,5	80,2	4,2	23,3	19,9	170
<b>Total</b>	<b>2506,2</b>	<b>2844,7</b>	<b>1454,8</b>	<b>1003,9</b>	<b>218,9</b>	<b>331,2</b>	<b>1171</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	11.48%		11.06%	10.63%	10.96%
15-35	11.22%		11.02%	11.20%	11.12%
36-60	10.26%		10.74%	10.66%	10.66%
61-90	—		10.28%	9.28%	9.85%
91-180	9.31%		9.65%	9.07%	9.40%
>180	8.52%		8.26%	7.73%	8.39%
<b>Total</b>	<b>10.42%</b>		<b>10.77%</b>	<b>10.74%</b>	<b>10.64%</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	02 – 06 oct.				09 - 13 oct.				16 - 20 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	63	66	4916	5235	147	136	7887	9217	52	132	6017	6642
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3175	2858	0	0	4923	3135	0	0	3099	1540
Otros <sup>c</sup>	66	63	663	648	136	147	1516	1439	132	52	463	1396
<b>Total</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>8754</b>	<b>8741</b>	<b>283</b>	<b>283</b>	<b>14326</b>	<b>13791</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>9579</b>	<b>9578</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.