

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2023**  
**Fecha de Información: 24 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\$4249 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.43%<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	912,2	1175,3	312,3	475,0	436,5	10,7	426,5
15-35	715,1	872,0	374,0	432,4	283,0	67,7	215,0
36-60	171,7	181,3	140,0	89,0	11,3	52,7	30,0
61-90	193,0	10,5	0,0	0,0	10,5	193,0	0,0
91-180	487,0	153,9	130,0	0,0	3,9	467,0	20,0
>180	7,8	60,8	41,0	2,6	19,8	5,2	0,0
<b>Total</b>	<b>2486,8</b>	<b>2453,7</b>	<b>997,3</b>	<b>999,0</b>	<b>764,9</b>	<b>796,3</b>	<b>691,5</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		Total	
	Compras/Ventas		Compras	Ventas		
3-14		11.84%		8.36%	11.46%	10.25%
15-35		11.78%		11.64%	10.01%	11.07%
36-60		10.48%		9.75%	10.85%	10.13%
61-90		—		10.92%	9.73%	9.79%
91-180		10.43%		9.17%	10.09%	9.90%
>180		—		9.26%	7.91%	8.97%
<b>Total</b>		<b>11.72%</b>		<b>9.89%</b>	<b>10.39%</b>	<b>10.43%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	23 – 27 oct.				30 oct. - 03 nov.				06 - 10 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	155	185	7417	8487	83	316	6941	8852	32	92	7207	7552
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4642	3259	0	0	4722	2505	0	0	4440	2878
Otros <sup>c</sup>	185	155	1234	1540	316	83	1501	1808	92	32	697	1365
<b>Total</b>	<b>340</b>	<b>340</b>	<b>13293</b>	<b>13286</b>	<b>399</b>	<b>399</b>	<b>13164</b>	<b>13165</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>12344</b>	<b>11795</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.