

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de agosto de 2023
Fecha de Información: 03 de agosto de 2023¹

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\$2962 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 14.12%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	422,5	617,1	414,4	209,2	13,5	24,1	189,2
15-35	800,7	826,8	604,5	472,5	18,0	0,0	328,2
36-60	77,8	47,8	30,0	25,0	14,8	49,8	3,0
61-90	21,3	249,7	240,0	0,0	9,7	21,3	0,0
91-180	16,0	58,9	23,3	0,0	35,6	16,0	0,0
>180	252,2	92,3	80,0	220,0	11,7	31,6	0,6
Total	1590,4	1892,6	1392,2	926,7	103,3	142,7	521,0

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c 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 ^a	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14.85%	14.28%	14.02%	14.43%
15-35	14.82%	15.02%	15.12%	15.01%
36-60	14.35%	14.25%	14.02%	14.11%
61-90	–	12.90%	11.20%	12.39%
91-180	–	11.21%	10.14%	10.98%
>180	8.70%	8.99%	8.86%	8.94%
Total	14.83%	13.81%	14.05%	14.12%

^a 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.

¹A 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.

²El 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	31 jul. - 04 ago.				07 - 11 ago.				14 - 18 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	10	94	5627	6067	24	160	4627	5378	211	215	6747	6619
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4374	4078	0	0	3503	2659	0	0	4399	3804
Otros ^c	94	10	465	320	160	24	386	438	215	211	529	1239
Total	104	104	10466	10465	184	184	8516	8475	426	426	11675	11662

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.