

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de agosto de 2023
Fecha de Información: 04 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\$3221 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 14.36%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	287,5	421,9	324,4	233,9	57,5	13,6	40,0
15-35	702,0	645,3	417,4	423,7	60,8	111,2	167,1
36-60	94,3	101,1	87,0	82,0	14,1	12,3	0,0
61-90	67,5	181,3	115,0	0,0	6,3	7,5	60,0
91-180	24,4	442,5	415,0	3,5	9,5	2,9	18,0
>180	467,6	85,4	40,0	445,0	30,4	7,6	15,0
Total	1643,3	1877,5	1398,8	1188,1	178,5	155,1	300,1

^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	14.01%	16.26%	13.88%	15.68%
15-35	14.44%	15.00%	14.90%	14.85%
36-60	–	13.89%	13.72%	13.78%
61-90	12.95%	12.78%	12.40%	12.82%
91-180	10.51%	11.19%	11.34%	10.93%
>180	8.87%	9.38%	8.39%	8.99%
Total	13.57%	14.67%	14.35%	14.36%

^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	5	64	1201	1246	25	167	4753	5532	211	216	6763	6784
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1026	980	0	0	3598	2770	0	0	4553	3804
Otros ^c	64	5	66	67	167	25	435	444	216	211	531	1245
Total	69	69	2293	2293	192	192	8786	8746	427	427	11847	11833

^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.