

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2023
Fecha de Información: 08 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\$2695 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 13.18%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	480,6	916,6	460,2	237,2	222,9	9,9	233,5
15-35	551,9	587,1	385,8	121,3	35,4	264,7	165,9
36-60	74,1	173,2	58,6	0,0	67,6	27,1	47,0
61-90	6,3	12,8	0,0	0,0	12,8	6,3	0,0
91-180	3,1	35,4	25,0	0,0	9,1	1,9	1,3
>180	160,0	204,4	129,9	96,8	11,5	0,2	63,0
Total	1276,0	1929,4	1059,5	455,3	359,2	310,0	510,7

^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	14.02%		12.47%	12.70%	12.98%
15-35	14.26%		14.31%	14.45%	14.36%
36-60	13.17%		13.61%	13.48%	13.48%
61-90	-		12.75%	12.02%	12.51%
91-180	11.64%		11.66%	10.63%	11.60%
>180	8.79%		9.40%	8.54%	9.01%
Total	13.36%		12.89%	13.51%	13.18%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	07 – 11 ago.				14 - 18 ago.				21 - 25 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	26	173	5107	5890	214	218	7035	7304	94	213	6176	5333
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3887	2941	0	0	4682	3893	0	0	2862	2781
Otros ^c	173	26	443	564	218	214	742	1246	213	94	554	1471
Total	199	199	9437	9395	432	432	12459	12443	307	307	9592	9585

^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.