

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de agosto de 2023
Fecha de Información: 09 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\$3675 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 13.69%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	645,7	1285,9	609,9	496,2	532,9	6,4	143,1
15-35	695,0	771,3	316,9	242,5	0,0	23,5	429,0
36-60	368,1	77,5	30,0	0,0	47,5	368,1	0,0
61-90	78,9	7,5	0,6	50,0	6,9	0,0	28,9
91-180	105,9	70,2	35,0	0,0	30,2	100,9	5,0
>180	70,9	134,2	70,0	35,9	34,2	5,0	30,0
Total	1964,5	2346,6	1062,4	824,6	651,7	503,9	636,0

^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	15.00%	14.31%	14.67%	14.47%
15-35	14.76%	13.79%	14.99%	14.46%
36-60	–	13.81%	12.71%	12.90%
61-90	–	12.95%	13.06%	13.05%
91-180	12.24%	11.72%	11.94%	11.87%
>180	8.81%	10.33%	8.65%	9.68%
Total	14.50%	13.69%	13.15%	13.69%

^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	20	140	4059	5188	215	222	7369	8345	94	214	6322	5573
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3553	2420	0	0	5057	4081	0	0	2989	2817
Otros ^c	140	20	319	313	222	215	1266	1248	214	94	558	1472
Total	160	160	7931	7921	437	437	13692	13674	308	308	9869	9862

^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.