

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2023
Fecha de Información: 10 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\$4598 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 13.48%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	1136,0	1876,0	1224,7	620,5	265,2	129,4	386,1
15-35	816,3	945,4	353,0	280,5	104,1	47,5	488,3
36-60	25,5	17,3	0,0	0,0	17,3	25,5	0,0
61-90	61,7	77,6	48,0	48,0	20,9	5,0	8,8
91-180	224,8	109,2	82,3	58,6	16,0	155,4	10,8
>180	149,0	91,5	30,0	75,0	23,5	36,0	38,0
Total	2413,4	3117,0	1738,1	1082,6	447,0	398,9	931,9

^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	14.51%	14.28%	11.53%	13.43%
15-35	14.46%	14.34%	14.75%	14.49%
36-60	–	14.55%	14.21%	14.35%
61-90	12.90%	12.66%	12.33%	12.54%
91-180	12.81%	12.15%	12.73%	12.57%
>180	10.66%	10.30%	9.80%	10.09%
Total	14.29%	13.95%	12.32%	13.48%

^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	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	10	97	3061	4169	215	224	8011	9308	95	216	6651	6295
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2976	1827	0	0	5680	4548	0	0	3480	2914
Otros ^c	97	10	231	270	224	215	1522	1340	216	95	561	1475
Total	107	107	6268	6266	439	439	15213	15196	311	311	10692	10684

^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.