

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2023
Fecha de Información: 14 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\$3461 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.70%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	632,2	1336,1	808,9	384,6	297,0	17,3	230,2
15-35	658,8	596,2	347,2	312,6	0,0	0,0	346,2
36-60	265,9	69,2	0,0	102,0	59,2	153,9	10,0
61-90	0,8	2,5	0,5	0,0	2,0	0,8	0,0
91-180	146,7	37,6	0,0	115,0	7,0	1,1	30,6
>180	305,7	186,2	15,0	5,0	11,2	140,7	160,0
Total	2010,0	2227,8	1171,7	919,3	376,3	313,7	777,0

^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	12.91%	10.61%	10.46%	10.99%
15-35	13.11%	13.25%	12.93%	13.08%
36-60	12.68%	13.01%	12.50%	12.60%
61-90	–	12.35%	11.93%	12.23%
91-180	11.03%	11.36%	11.98%	11.53%
>180	10.49%	9.63%	10.65%	10.49%
Total	12.30%	11.23%	11.86%	11.70%

^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	14 – 18 ago.				21 - 25 ago.				28 ago. - 01 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	218	231	8714	10277	97	230	7044	7392	62	265	6429	5065
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	6201	4985	0	0	4278	3146	0	0	3026	3208
Otros ^c	231	218	1735	1371	230	97	707	1484	265	62	657	1837
Total	449	449	16650	16633	327	327	12029	12022	327	327	10112	10110

^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.