

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de agosto de 2023
Fecha de Información: 15 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\$5300 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.55%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	1255,9	1245,5	289,3	808,1	528,7	20,2	427,6
15-35	972,3	1665,4	920,1	172,9	0,0	91,9	707,5
36-60	655,5	72,0	40,0	58,0	2,0	567,5	30,1
61-90	50,6	8,0	2,4	48,0	5,6	2,6	0,0
91-180	36,9	37,7	15,0	30,0	22,7	6,9	0,0
>180	304,3	302,8	177,2	162,8	5,5	0,0	141,5
Total	3275,5	3331,5	1444,0	1279,7	564,5	689,1	1306,7

^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	13.58%	5.54%	13.40%	9.42%
15-35	13.44%	13.68%	13.42%	13.52%
36-60	13.28%	12.80%	11.79%	11.92%
61-90	–	12.58%	12.45%	12.47%
91-180	–	11.74%	11.30%	11.51%
>180	10.76%	10.42%	10.00%	10.55%
Total	13.23%	9.14%	12.40%	11.55%

^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	38	193	7445	8856	100	233	7721	8519	63	265	6612	5270
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	5420	3864	0	0	4452	3382	0	0	3119	3232
Otros ^c	193	38	1162	1291	233	100	1228	1493	265	63	669	1896
Total	231	231	14027	14011	333	333	13401	13394	328	328	10400	10398

^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.