

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de agosto de 2023
Fecha de Información: 16 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\$4338 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 12.94%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	1486,1	959,9	505,9	849,6	75,1	257,5	379,0
15-35	843,8	1150,8	765,0	402,3	17,5	73,2	368,3
36-60	95,3	197,6	58,3	50,0	99,4	5,3	40,0
61-90	13,2	44,4	34,7	0,0	9,7	13,2	0,0
91-180	81,7	120,9	10,0	19,4	75,9	27,3	35,0
>180	123,7	71,2	10,0	16,7	33,2	79,0	28,0
Total	2643,7	2544,9	1383,8	1338,0	310,8	455,5	850,3

^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%	13.46%	12.20%	12.80%
15-35	13.23%	13.80%	13.28%	13.54%
36-60	13.16%	13.01%	12.52%	12.91%
61-90	–	12.81%	12.34%	12.54%
91-180	11.75%	11.39%	11.45%	11.49%
>180	9.71%	9.67%	10.62%	10.18%
Total	13.20%	13.37%	12.36%	12.94%

^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 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	35	160	6787	7219	115	233	7871	8929	63	265	6875	5477
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4455	3960	0	0	4679	3417	0	0	3271	3335
Otros ^c	160	35	1049	1095	233	115	1298	1496	265	63	674	2006
Total	195	195	12291	12274	348	348	13848	13842	328	328	10820	10818

^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.