

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2023
Fecha de Información: 17 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\$2088 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.78%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	263,8	271,5	164,0	139,6	13,6	30,3	93,9
15-35	842,9	760,3	285,7	367,3	10,7	11,7	463,9
36-60	96,0	160,7	100,0	20,0	5,7	21,0	55,0
61-90	96,8	67,0	5,0	58,0	27,0	3,8	35,0
91-180	36,9	29,5	10,0	20,0	4,5	1,9	15,0
>180	39,4	85,9	70,0	30,0	15,9	9,4	0,0
Total	1375,7	1375,0	634,7	634,9	77,5	78,0	662,8

^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	12.10%	12.19%	10.42%	11.55%
15-35	11.96%	12.20%	12.06%	12.05%
36-60	11.82%	11.89%	12.23%	11.94%
61-90	11.60%	11.72%	11.77%	11.71%
91-180	11.21%	11.44%	10.70%	11.21%
>180	–	8.47%	9.64%	8.84%
Total	11.94%	11.82%	11.52%	11.78%

^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	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	27	120	4570	4637	116	240	7977	9049	63	267	7029	5632
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3289	3146	0	0	4787	3493	0	0	3328	3388
Otros ^c	120	27	255	325	240	116	1301	1516	267	63	675	2009
Total	147	147	8114	8108	356	356	14065	14058	330	330	11032	11029

^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.