

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2023
Fecha de Información: 18 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\$3362 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.14%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	632,3	755,7	483,3	525,1	177,1	11,9	95,2
15-35	620,1	1014,6	732,6	131,6	18,8	225,4	263,1
36-60	4,4	0,8	0,0	0,0	0,8	4,4	0,0
61-90	22,5	13,0	2,4	0,0	10,5	22,5	0,0
91-180	347,7	104,2	37,4	280,0	1,8	2,7	65,0
>180	182,5	87,3	73,0	181,5	14,3	1,0	0,0
Total	1809,5	1975,5	1328,8	1118,2	223,4	268,0	423,3

^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	11.22%	9.01%	9.23%	9.32%
15-35	11.18%	11.31%	10.44%	10.97%
36-60	–	11.81%	11.38%	11.44%
61-90	–	11.15%	10.94%	11.02%
91-180	10.51%	11.04%	10.61%	10.57%
>180	–	9.23%	8.67%	8.96%
Total	11.09%	9.81%	9.96%	10.14%

^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	5	75	1318	1401	118	241	8399	9404	66	268	7028	5996
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	852	750	0	0	4980	3906	0	0	3593	3305
Otros ^c	75	5	148	161	241	118	1458	1520	268	66	694	2011
Total	80	80	2318	2312	359	359	14837	14830	334	334	11315	11312

^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.