

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2023
Fecha de Información: 22 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\$3578 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.47%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	481,6	918,6	617,3	340,6	170,3	10,0	131,0
15-35	554,4	694,7	421,6	314,0	57,1	24,4	216,0
36-60	279,7	154,3	111,9	88,0	7,4	156,7	35,0
61-90	62,4	4,9	0,3	0,0	4,6	62,4	0,0
91-180	191,2	192,9	168,0	167,0	4,5	3,7	20,5
>180	393,0	205,4	45,0	235,3	8,2	5,5	152,2
Total	1962,3	2170,8	1364,1	1144,9	252,0	262,7	554,7

^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	10.81%	11.10%	10.63%	10.95%
15-35	10.93%	12.58%	10.72%	11.61%
36-60	10.45%	10.48%	10.52%	10.51%
61-90	–	10.75%	3.52%	4.01%
91-180	10.40%	10.08%	9.61%	10.25%
>180	8.31%	9.40%	7.74%	8.42%
Total	10.14%	11.55%	9.43%	10.47%

^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	21 – 25 ago.				28 ago. - 01 sep.				04 - 08 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	119	243	8968	9718	68	269	7141	6514	14	129	6049	5233
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5136	4198	0	0	3892	3358	0	0	3486	3092
Otros ^c	243	119	1490	1671	269	68	857	2016	129	14	264	1469
Total	362	362	15594	15587	337	337	11890	11888	143	143	9799	9794

^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.