

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2023
Fecha de Información: 25 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\$3343 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.54%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	627,7	812,6	358,3	453,4	303,3	23,4	151,0
15-35	342,9	826,3	680,8	202,3	27,4	22,6	118,0
36-60	355,9	12,7	0,0	25,0	12,7	330,9	0,0
61-90	64,4	71,2	50,0	43,1	6,2	6,3	15,0
91-180	124,7	158,3	105,0	78,7	13,3	6,1	40,0
>180	194,4	188,7	60,0	80,0	15,4	1,1	113,3
Total	1710,0	2069,9	1254,1	882,3	378,5	390,4	437,3

^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	10.03%		9.76%	8.39%	9.33%
15-35	10.04%		10.07%	9.79%	10.04%
36-60	-		10.28%	9.94%	9.95%
61-90	9.61%		9.62%	9.50%	9.58%
91-180	9.21%		9.33%	9.16%	9.25%
>180	7.95%		8.20%	8.31%	8.06%
Total	9.40%		9.84%	9.21%	9.54%

^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	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	96	92	613	733	76	275	7864	8859	18	131	6306	5465
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	488	365	0	0	4949	3749	0	0	3611	3227
Otros ^c	92	96	51	55	275	76	1838	2041	131	18	281	1500
Total	188	188	1152	1153	351	351	14651	14649	149	149	10198	10192

^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.