

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de agosto de 2023
Fecha de Información: 28 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\$3637 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.83%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	558,2	1072,7	373,6	227,4	383,1	14,7	316
15-35	771,7	1049,0	376,0	135,6	85,9	49,1	587
36-60	475,0	27,4	15,0	120,8	12,4	354,3	0
61-90	1,7	10,5	10,0	0,0	0,5	1,7	0
91-180	72,3	16,0	0,0	24,2	16,0	48,1	0
>180	354,2	331,7	114,8	151,9	17,0	2,3	200
Total	2233,0	2507,3	889,4	659,9	514,9	470,2	1103

^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	10.25%		9.91%	9.36%	9.92%
15-35	10.32%		10.56%	9.01%	10.23%
36-60	-		10.04%	10.11%	10.11%
61-90	-		9.98%	9.31%	9.47%
91-180	-		9.22%	9.10%	9.13%
>180	8.24%		7.41%	8.04%	8.07%
Total	9.93%		9.96%	9.54%	9.83%

^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	28 ago. - 01 sep.				04 - 08 sep.				11 - 15 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	77	276	8527	9400	20	132	6345	5928	26	145	6766	8295
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5193	3943	0	0	3729	3255	0	0	5449	2119
Otros ^c	276	77	1888	2262	132	20	620	1505	145	26	408	1638
Total	353	353	15608	15605	152	152	10694	10688	171	171	12623	12052

^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.