

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2023
Fecha de Información: 29 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\$3512 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.84%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	325,4	587,8	196,8	113,0	362,4	183,9	28,5
15-35	853,3	1234,8	586,9	350,0	184,5	39,8	463,5
36-60	24,5	41,4	1,6	0,0	39,8	24,5	0,0
61-90	2,6	6,8	0,0	0,0	6,8	2,6	0,0
91-180	323,8	120,2	67,2	65,0	18,0	223,8	35,0
>180	396,7	272,0	117,0	133,5	5,0	113,2	150,0
Total	1926,3	2262,9	969,5	661,5	616,5	587,7	677,0

^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	10.86%		10.49%	8.07%	9.65%
15-35	10.83%		9.99%	10.49%	10.36%
36-60	-		10.51%	9.88%	10.27%
61-90	-		9.71%	9.03%	9.52%
91-180	9.45%		9.37%	9.78%	9.69%
>180	8.57%		7.93%	8.41%	8.44%
Total	10.26%		10.12%	9.17%	9.84%

^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	71	215	8235	8938	24	139	6603	6515	38	146	6895	8505
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	4909	3784	0	0	3834	3375	0	0	5532	2119
Otros ^c	215	71	1849	2268	139	24	967	1508	146	38	415	1641
Total	286	286	14993	14990	163	163	11404	11398	184	184	12842	12265

^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.