

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de agosto de 2023
Fecha de Información: 31 de julio 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\$5025 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.72%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	539,1	465,3	355,0	424,1	11,3	16,0	99
15-35	1004,5	722,5	337,0	616,8	34,5	36,7	351
36-60	335,2	204,4	145,0	307,7	39,4	7,4	20
61-90	623,3	29,3	20,0	620,0	9,3	3,3	0
91-180	55,8	719,4	633,0	10,0	41,4	0,8	45
>180	182,5	688,6	616,3	152,1	42,2	0,4	30
Total	2740,4	2829,4	2106,3	2130,7	178,1	64,7	545

^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	12.31%	12.46%	12.07%	12.31%
15-35	12.35%	12.50%	12.37%	12.39%
36-60	11.27%	11.35%	11.20%	11.32%
61-90	–	10.80%	10.76%	10.78%
91-180	10.35%	10.04%	10.37%	10.20%
>180	8.98%	8.84%	8.27%	8.66%
Total	11.95%	11.62%	11.57%	11.72%

^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	31 jul. - 04 ago.				07 - 11 ago.				14 - 18 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	32	213	6796	8083	19	154	4161	4478	205	211	6259	5814
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5324	4274	0	0	2898	2435	0	0	3641	3404
Otros ^c	213	32	962	725	154	19	315	420	211	205	518	1188
Total	245	245	13082	13082	173	173	7374	7333	416	416	10418	10406

^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.