

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de agosto de 2023
Fecha de Información: 01 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\$2575 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.02%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	245,9	345,7	253,2	191,3	56,8	18,8	35,7
15-35	641,5	806,2	617,2	376,2	45,4	121,7	143,5
36-60	93,4	44,0	25,2	20,9	13,8	67,4	5,0
61-90	7,1	124,3	121,6	0,0	2,7	7,1	0,0
91-180	164,2	60,5	0,0	140,0	40,5	4,2	20,0
>180	168,5	91,2	75,0	107,9	3,2	47,6	13,0
Total	1320,6	1471,9	1092,2	836,4	162,5	266,9	217,2

^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	12.47%		12.57%	12.32%	12.47%
15-35	12.46%		12.75%	10.03%	11.44%
36-60	11.21%		11.71%	11.76%	11.72%
61-90	-		9.12%	10.57%	9.20%
91-180	10.25%		10.12%	9.70%	10.14%
>180	8.55%		8.29%	7.81%	7.99%
Total	12.00%		11.44%	10.25%	11.02%

^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	16	148	6380	7582	22	154	4172	4654	208	214	6353	6196
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5211	4217	0	0	3025	2435	0	0	4000	3479
Otros ^c	148	16	730	522	154	22	360	427	214	208	529	1194
Total	164	164	12321	12321	176	176	7557	7516	422	422	10882	10869

^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.