

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de agosto de 2023
Fecha de Información: 02 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\$4159 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.97%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1239,9	404,3	316,8	1167,7	25,0	9,6	62,5
15-35	653,1	1429,0	1275,9	442,1	28,4	86,3	124,8
36-60	175,1	87,8	85,3	141,0	2,4	34,1	0,0
61-90	71,6	53,2	35,0	39,5	8,2	22,1	10,0
91-180	39,8	69,2	25,0	0,0	9,2	4,8	35,0
>180	28,4	140,0	128,0	19,2	12,0	9,2	0,0
Total	2208,0	2183,3	1866,0	1809,5	85,1	166,2	232,3

^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	13.01%	13.06%	11.47%	12.16%
15-35	13.17%	12.99%	11.66%	12.56%
36-60	–	12.25%	12.06%	12.07%
61-90	12.04%	10.81%	10.67%	10.90%
91-180	10.00%	10.37%	9.17%	10.08%
>180	–	8.29%	8.29%	8.29%
Total	12.60%	12.23%	11.53%	11.97%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	15	132	6135	6728	23	157	4325	4805	209	215	6554	6410
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4667	4267	0	0	3122	2548	0	0	4203	3641
Otros ^c	132	15	577	384	157	23	378	432	215	209	529	1222
Total	147	147	11379	11379	180	180	7825	7785	424	424	11286	11273

^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.