

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de agosto de 2023
Fecha de Información: 23 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\$3897 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.16%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	544,8	1024,6	660,7	376,1	0,0	17,2	151,5
15-35	950,6	792,7	452,5	424,4	5,2	191,2	335,0
36-60	2,4	7,7	0,0	0,0	7,7	2,4	0,0
61-90	209,0	270,2	218,0	146,9	12,2	22,1	40,0
91-180	159,9	151,6	96,6	110,0	9,9	4,9	45,0
>180	326,5	51,8	10,0	189,5	18,8	114,0	23,0
Total	2193,1	2298,5	1437,8	1246,9	53,8	351,7	594,5

^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	10.47%		9.87%	10.39%	10.14%
15-35	10.46%		10.53%	10.10%	10.36%
36-60	—		10.84%	10.28%	10.71%
61-90	10.24%		10.24%	10.20%	10.23%
91-180	10.29%		10.05%	10.26%	10.16%
>180	8.04%		9.42%	9.23%	9.11%
Total	10.34%		10.15%	10.05%	10.16%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	21 - 25 ago.				28 ago. - 01 sep.				04 - 08 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	109	191	7030	7418	70	272	7185	7231	15	129	6132	5276
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4071	3461	0	0	4384	3375	0	0	3520	3162
Otros ^c	191	109	643	862	272	70	1061	2023	129	15	268	1476
Total	300	300	11744	11741	342	342	12630	12629	144	144	9920	9914

^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.