

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de junio de 2023
Fecha de Información: 15 de junio 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\$5463 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.64%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	928,2	866,4	505,2	583,6	27,2	10,6	334,0
15-35	678,2	853,8	547,0	340,0	15,6	47,0	291,2
36-60	13,2	45,8	5,0	0,0	40,8	13,2	0,0
61-90	384,8	58,2	20,0	345,0	10,2	11,8	28,0
91-180	86,6	510,0	420,8	30,0	39,2	6,6	50,0
>180	869,0	882,6	858,0	854,0	14,1	4,5	10,5
Total	2959,9	3216,8	2356,0	2152,6	147,0	93,6	713,7

^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	10.93%	10.86%	11.29%	11.03%
15-35	10.63%	10.96%	10.76%	10.79%
36-60	–	10.67%	9.97%	10.50%
61-90	9.89%	9.81%	10.48%	10.01%
91-180	8.88%	8.75%	8.93%	8.80%
>180	7.63%	7.85%	6.98%	7.37%
Total	10.58%	10.55%	10.86%	10.64%

^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	12 - 16 jun.				19 - 23 jun.				26 - 30 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	31	144	8875	9235	24	220	5487	6587	19	241	7743	8749
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4652	4333	0	0	3451	2456	0	0	3928	3292
Otros ^c	144	31	974	910	220	24	1104	989	241	19	1785	1416
Total	175	175	14501	14478	244	244	10042	10032	260	260	13456	13457

^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.