

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2023
Fecha de Información: 16 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\$2724 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.21%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	350,1	763,1	577,1	201,3	81,0	43,8	105,0
15-35	857,4	784,9	344,9	439,2	124,3	0,0	418,2
36-60	11,2	13,0	0,0	0,0	13,0	11,2	0,0
61-90	80,9	5,5	0,0	74,0	5,5	6,9	0,0
91-180	80,1	142,7	60,2	36,0	39,6	1,1	43,0
>180	78,0	153,5	110,0	35,0	13,5	13,0	30,0
Total	1457,7	1862,8	1092,2	785,5	276,8	76,0	596,2

^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	12.32%	11.85%	4.87%	10.70%
15-35	12.19%	12.99%	12.16%	12.43%
36-60	–	11.44%	11.69%	11.55%
61-90	–	10.38%	10.59%	10.58%
91-180	8.87%	8.85%	10.04%	9.08%
>180	8.63%	8.79%	7.39%	8.44%
Total	11.71%	11.54%	10.38%	11.21%

^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	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	18	83	4394	4531	39	224	5750	6995	20	249	7800	9071
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2578	2430	0	0	3735	2621	0	0	4178	3292
Otros ^c	83	18	234	225	224	39	1148	1006	249	20	1811	1427
Total	101	101	7206	7186	263	263	10633	10622	269	269	13789	13790

^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.