

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de junio de 2023
Fecha de Información: 23 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\$3721 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.62%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	1202,4	1018,4	417,9	593,7	16,5	24,6	584,0
15-35	1093,6	1365,7	680,1	337,8	19,0	89,3	666,5
36-60	6,2	3,4	0,0	0,0	3,4	6,2	0,0
61-90	64,6	57,8	21,7	26,9	6,1	7,7	30,0
91-180	24,2	85,4	55,0	0,0	10,4	4,2	20,0
>180	45,1	74,6	45,0	20,0	9,6	5,1	20,0
Total	2435,9	2605,3	1219,7	978,4	65,1	137,0	1320,5

^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	12.25%	10.42%	10.28%	11.32%
15-35	12.25%	12.06%	12.28%	12.19%
36-60	–	11.80%	11.12%	11.36%
61-90	10.66%	10.45%	10.31%	10.52%
91-180	9.49%	9.42%	8.69%	9.39%
>180	8.22%	7.96%	7.32%	7.94%
Total	12.11%	11.28%	10.90%	11.62%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	19 – 23 jun.				26 - 30 jun.				03 - 07 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	19	59	550	707	34	268	9574	10732	27	155	3427	4099
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	390	206	0	0	5058	4238	0	0	2912	1855
Otros ^c	59	19	70	97	268	34	1830	1492	155	27	277	662
Total	78	78	1010	1010	302	302	16462	16462	182	182	6616	6616

^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.