

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de junio de 2023
Fecha de Información: 26 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\$3599 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.64%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	796,5	592,0	280,5	488,1	29,4	26,3	282,1
15-35	918,9	1188,7	601,0	292,7	21,3	59,8	566,4
36-60	430,6	263,0	108,7	283,0	14,3	7,6	140,0
61-90	2,5	36,7	0,2	2,0	36,5	0,6	0,0
91-180	119,1	156,9	115,0	87,5	11,9	1,6	30,0
>180	48,1	79,5	60,0	30,3	4,5	2,8	15,0
Total	2315,8	2316,8	1165,4	1183,6	117,9	98,7	1033,5

^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	12.36%	12.98%	10.47%	11.58%
15-35	12.22%	12.06%	12.32%	12.18%
36-60	11.66%	11.15%	11.04%	11.57%
61-90	–	9.75%	9.68%	9.75%
91-180	9.64%	9.46%	9.31%	9.44%
>180	8.11%	8.52%	7.18%	8.14%
Total	12.05%	11.73%	10.91%	11.64%

^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	26 – 30 jun.				03 - 07 jul.				10 - 14 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	37	268	10260	11151	31	155	3446	4194	80	217	5602	5186
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5230	4609	0	0	2993	1855	0	0	2892	2384
Otros ^c	268	37	1857	1587	155	31	279	668	217	80	433	1355
Total	305	305	17347	17347	186	186	6718	6717	297	297	8927	8925

^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.