

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de julio de 2023
Fecha de Información: 29 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\$4867 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.22%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	917,7	648,7	275,0	669,6	190,2	64,6	183,5
15-35	1018,6	1712,8	1166,4	516,8	108,9	64,2	437,6
36-60	198,4	140,9	118,0	0,0	12,9	188,4	10,0
61-90	493,2	68,6	7,5	445,0	16,1	3,2	45,0
91-180	26,3	166,9	129,7	0,0	17,2	6,3	20,0
>180	110,2	105,9	47,0	65,0	13,9	0,2	45,0
Total	2764,4	2843,8	1743,6	1696,3	359,1	327,0	741,1

^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	11.95%		5.75%	8.90%	8.44%
15-35	11.82%		11.60%	11.42%	11.61%
36-60	11.52%		11.04%	9.84%	10.29%
61-90	10.43%		10.43%	9.81%	10.36%
91-180	9.45%		9.44%	9.15%	9.43%
>180	8.19%		8.42%	7.38%	8.01%
Total	11.48%		9.88%	9.86%	10.22%

^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	20	106	6151	6477	41	156	4275	5331	88	219	6083	5671
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3374	3065	0	0	3413	2412	0	0	3064	2512
Otros ^c	106	20	625	610	156	41	729	674	219	88	447	1408
Total	126	126	10150	10152	197	197	8417	8417	307	307	9594	9591

^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.