

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de julio de 2023
Fecha de Información: 12 de julio 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\$2638 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.79%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	531,9	438,8	170,5	423,6	188,2	28,2	80,0
15-35	581,0	1061,2	712,7	247,0	31,3	16,9	317,1
36-60	5,9	17,2	0,0	0,0	16,4	5,1	0,8
61-90	182,7	29,5	0,0	0,0	19,4	172,6	10,1
91-180	26,8	34,7	0,0	10,0	24,7	6,8	10,0
>180	96,6	146,0	45,0	0,0	11,0	0,0	96,6
Total	1424,9	1727,3	928,3	680,6	290,9	229,7	514,6

^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	10.56%		8.60%	10.34%	9.47%
15-35	10.54%		10.56%	10.34%	10.50%
36-60	9.58%		10.04%	9.92%	10.00%
61-90	9.45%		9.46%	9.32%	9.34%
91-180	9.13%		9.13%	8.91%	9.06%
>180	7.51%		6.92%	7.52%	7.29%
Total	9.95%		9.54%	10.01%	9.79%

^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	10 – 14 jul.				17 - 21 jul.				24 - 28 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	95	151	5796	5701	29	232	6421	8092	117	315	8071	6999
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3043	3059	0	0	4883	3143	0	0	3605	3657
Otros ^c	151	95	726	800	232	29	1510	1571	315	117	853	1867
Total	246	246	9565	9560	261	261	12814	12806	432	432	12529	12523

^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.