

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2023
Fecha de Información: 13 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\$3097 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.66%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	701,5	476,0	337	580,6	111,0	92,9	28
15-35	575,6	1251,5	776	182,5	115,5	33,1	360
36-60	22,8	32,8	15	0,0	17,8	22,8	0
61-90	105,0	42,3	5	0,0	17,3	85,0	20
91-180	71,7	78,4	25	60,0	53,4	11,7	0
>180	108,7	113,3	35	30,0	3,3	3,7	75
Total	1585,3	1994,4	1193	853,1	318,4	249,2	483

^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	9.98%		10.34%	9.50%	9.87%
15-35	10.16%		9.61%	10.16%	9.86%
36-60	-		9.77%	9.72%	9.75%
61-90	9.35%		9.60%	9.40%	9.42%
91-180	-		8.77%	8.87%	8.79%
>180	7.12%		7.41%	7.15%	7.19%
Total	9.64%		9.74%	9.55%	9.66%

^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	84	104	3384	3588	29	237	6856	8358	118	319	8200	7311
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2192	1965	0	0	5094	3488	0	0	3767	3688
Otros ^c	104	84	359	382	237	29	1560	1657	319	118	909	1871
Total	188	188	5935	5935	266	266	13510	13503	437	437	12876	12870

^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.