

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2023
Fecha de Información: 17 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\$3523 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.64%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	454,9	940,0	321,7	392,8	581,6	25,5	36,6
15-35	569,0	866,0	576,6	259,9	25,8	45,5	263,6
36-60	494,6	103,0	0,0	99,0	37,9	330,5	65,1
61-90	270,1	20,6	0,0	0,0	20,6	270,1	0,0
91-180	34,3	70,7	0,0	0,0	70,7	34,3	0,0
>180	47,1	18,4	15,0	47,0	3,4	0,1	0,0
Total	1869,9	2018,6	913,3	798,7	740,0	705,9	365,3

^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	11.73%	10.29%	9.64%	10.20%
15-35	12.10%	11.14%	10.84%	11.32%
36-60	12.34%	11.37%	11.29%	11.43%
61-90	–	10.63%	9.70%	9.77%
91-180	–	9.36%	9.16%	9.30%
>180	–	8.67%	7.80%	8.04%
Total	12.10%	10.51%	10.38%	10.64%

^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	17 – 21 jul.				24 - 28 jul.				31 jul. - 04 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	35	241	7554	8660	119	340	8300	8248	25	196	4494	6154
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5314	4060	0	0	4057	3706	0	0	4242	2612
Otros ^c	241	35	1603	1744	340	119	1516	1913	196	25	418	387
Total	276	276	14471	14464	459	459	13873	13867	221	221	9154	9153

^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.