

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de julio de 2023
Fecha de Información: 18 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\$5300 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.80%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	973,3	1251,6	569,5	881,5	609,1	18,9	73
15-35	435,5	795,2	663,3	285,4	25,0	43,2	107
36-60	546,8	166,7	135,0	250,0	31,7	296,8	0
61-90	510,7	120,3	50,7	59,3	49,6	431,5	20
91-180	29,7	119,7	44,1	0,0	53,6	7,7	22
>180	135,8	451,5	392,9	118,2	43,7	2,6	15
Total	2631,8	2905,1	1855,4	1594,3	812,7	800,5	237

^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	10.04%	10.05%	11.71%	10.52%
15-35	12.34%	12.13%	12.35%	12.21%
36-60	–	11.68%	11.15%	11.19%
61-90	10.49%	10.24%	9.89%	9.97%
91-180	9.74%	9.70%	8.72%	9.63%
>180	8.05%	8.19%	7.58%	8.06%
Total	10.96%	10.66%	10.91%	10.80%

^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	24	207	6504	7088	120	346	8707	9353	25	197	4561	6222
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4768	3872	0	0	4538	4073	0	0	4306	2675
Otros ^c	207	24	879	1184	346	120	2112	1926	197	25	422	392
Total	231	231	12151	12144	466	466	15357	15352	222	222	9289	9289

^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.