

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de julio de 2023
Fecha de Información: 21 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\$3735 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.72%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	406,7	633,2	379,0	265,7	157,2	43,9	97,0
15-35	878,6	673,6	353,4	564,3	57,3	51,3	263,0
36-60	158,1	320,5	308,9	46,1	11,6	112,0	0,0
61-90	14,8	327,0	307,0	0,0	10,0	4,8	10,0
91-180	377,7	53,0	20,4	354,0	32,6	0,0	23,7
>180	139,9	145,6	98,0	128,5	47,6	11,4	0,0
Total	1975,7	2152,9	1466,7	1358,6	316,2	223,4	393,7

^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	12.45%	12.66%	9.94%	11.82%
15-35	12.98%	12.48%	12.98%	12.77%
36-60	–	12.26%	11.90%	11.92%
61-90	11.46%	11.17%	10.70%	11.19%
91-180	–	9.79%	9.56%	9.64%
>180	–	8.27%	7.85%	8.06%
Total	12.80%	11.98%	10.70%	11.72%

^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	9	59	1108	1188	123	349	9094	10406	25	200	4859	6370
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	798	700	0	0	5236	4336	0	0	4421	2818
Otros ^c	59	9	130	149	349	123	2359	1941	200	25	432	525
Total	68	68	2036	2037	472	472	16689	16683	225	225	9712	9713

^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.