

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2023
Fecha de Información: 24 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\$2845 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.60%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	819,6	533,8	271,6	598,5	119,2	78,2	143,0
15-35	831,2	831,7	458,9	383,1	84,3	159,6	288,5
36-60	21,5	14,5	2,0	9,1	12,5	12,4	0,0
61-90	3,3	3,4	0,0	0,0	3,4	3,3	0,0
91-180	41,4	90,0	54,5	40,0	35,6	1,4	0,0
>180	69,6	36,6	14,8	35,0	1,8	14,6	20,0
Total	1786,7	1510,2	801,8	1065,7	256,9	269,5	451,5

^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	12.27%	12.49%	12.49%	12.45%
15-35	12.51%	10.72%	11.15%	11.36%
36-60	–	12.30%	12.25%	12.28%
61-90	–	10.99%	10.57%	10.78%
91-180	–	10.07%	10.08%	10.07%
>180	8.50%	8.82%	7.79%	8.03%
Total	12.26%	11.17%	11.60%	11.60%

^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	24 – 28 jul.				31 jul. - 04 ago.				07 - 11 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	124	351	10017	10674	26	204	5007	6631	13	146	3624	3744
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5352	4898	0	0	4539	2924	0	0	2354	2128
Otros ^c	351	124	2416	2207	204	26	537	528	146	13	305	369
Total	475	475	17785	17779	230	230	10083	10083	159	159	6283	6241

^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.