

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de julio de 2023
Fecha de Información: 26 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\$3101 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.55%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	636,8	638,1	206,2	183,5	122,9	144,2	309,0
15-35	865,8	955,9	533,3	361,4	68,1	149,9	354,5
36-60	120,1	182,1	49,0	66,3	133,1	53,8	0,0
61-90	77,4	77,2	13,4	60,0	53,9	7,4	10,0
91-180	35,9	97,6	15,0	12,0	0,0	3,9	20,0
>180	73,9	69,7	30,0	20,0	4,2	18,4	35,5
Total	1809,9	2020,6	846,9	703,2	382,1	377,7	729,0

^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	12.26%	12.07%	8.94%	11.29%
15-35	12.22%	12.50%	12.27%	12.34%
36-60	–	11.55%	12.44%	11.92%
61-90	10.55%	10.30%	10.11%	10.22%
91-180	9.86%	9.72%	9.68%	9.74%
>180	8.37%	8.89%	7.62%	8.27%
Total	11.96%	11.72%	10.94%	11.55%

^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	15	228	5414	5297	29	207	5723	7212	13	152	3834	4093
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2356	2509	0	0	4766	3288	0	0	2642	2243
Otros ^c	228	15	1557	1514	207	29	710	700	152	13	311	410
Total	243	243	9327	9320	236	236	11199	11200	165	165	6787	6746

^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.