

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2023
Fecha de Información: 27 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\$5028 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.68%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	911,8	616,4	392,9	774,8	117,5	31,0	106,0
15-35	1215,8	1236,9	888,7	661,2	0,0	269,1	285,5
36-60	57,9	73,6	55,3	43,1	18,3	14,8	0,0
61-90	456,1	41,9	0,0	441,0	31,9	5,1	10,0
91-180	21,1	151,9	96,4	0,6	45,5	10,5	10,0
>180	100,5	555,7	507,0	98,5	48,7	2,0	0,0
Total	2763,1	2676,3	1940,2	2019,2	261,8	332,5	411,5

^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	12.10%	10.34%	9.31%	10.00%
15-35	11.95%	11.56%	11.28%	11.53%
36-60	–	11.52%	11.52%	11.52%
61-90	10.41%	10.54%	10.39%	10.50%
91-180	10.18%	9.70%	9.82%	9.76%
>180	–	8.31%	7.93%	8.18%
Total	11.91%	10.71%	10.25%	10.68%

^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	9	180	3188	3389	30	207	6125	7461	15	152	4016	4275
Intragruppo y off-shore ^b	1	0	1581	1575	0	0	4878	3659	0	0	2764	2362
Otros ^c	179	9	1064	864	207	30	822	704	152	15	312	413
Total	189	189	5833	5828	237	237	11825	11824	167	167	7092	7050

^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.