

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de agosto de 2023
Fecha de Información: 28 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\$3000 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.83%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	354,2	535,1	380,3	328,5	139,8	10,8	15,0
15-35	515,8	374,5	269,9	405,4	79,6	85,5	25,0
36-60	149,2	27,0	12,3	1,7	14,7	147,6	0,0
61-90	85,2	27,0	10,5	60,0	11,6	20,2	5,0
91-180	26,4	218,5	100,8	10,0	103,0	1,7	14,7
>180	323,2	423,6	390,0	322,3	33,6	0,9	0,0
Total	1454,1	1605,8	1163,8	1127,8	382,3	266,7	59,7

^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	11.58%	10.75%	8.08%	10.03%
15-35	11.90%	12.52%	12.14%	12.28%
36-60	–	11.76%	11.97%	11.94%
61-90	11.12%	11.01%	11.01%	11.01%
91-180	9.89%	10.02%	9.66%	10.00%
>180	–	8.52%	8.29%	8.43%
Total	11.26%	10.86%	10.75%	10.83%

^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	6	70	751	722	32	212	6364	7875	16	152	4071	4285
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	215	270	0	0	5145	3877	0	0	2772	2415
Otros ^c	69	6	291	259	212	32	954	711	152	16	314	415
Total	76	76	1257	1251	244	244	12463	12463	168	168	7157	7115

^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.