

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de junio de 2023
Fecha de Información: 20 de junio 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\$2340 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 13.61%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	303,5	195,1	58,0	137,1	5,1	34,3	132,0
15-35	524,2	791,4	677,0	365,3	32,4	76,9	82,0
36-60	166,6	19,9	13,0	160,0	1,9	1,6	5,0
61-90	9,8	15,7	11,7	9,1	4,0	0,7	0,0
91-180	41,4	108,1	90,0	30,0	8,1	1,4	10,0
>180	131,2	282,5	258,1	100,0	4,1	10,9	20,3
Total	1176,7	1412,9	1107,9	801,5	55,7	125,8	249,3

^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	14.36%	14.53%	13.41%	14.04%
15-35	14.92%	14.81%	15.36%	14.98%
36-60	12.55%	12.51%	12.45%	12.46%
61-90	–	11.71%	10.31%	11.50%
91-180	10.52%	10.59%	10.49%	10.57%
>180	8.29%	8.71%	7.65%	8.20%
Total	13.86%	13.77%	13.26%	13.61%

^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	19 – 23 jun.				26 - 30 jun.				03 - 07 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	224	6013	7101	22	251	7885	9178	10	151	3338	3736
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3781	2784	0	0	4232	3305	0	0	2633	1855
Otros ^c	224	47	1151	1050	251	22	1812	1446	151	10	271	650
Total	271	271	10945	10935	273	273	13929	13929	161	161	6242	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.