

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de junio de 2023
Fecha de Información: 21 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\$2926 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 14.34%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	531,3	531,2	459,0	438,0	6,7	27,8	65,5
15-35	735,0	392,1	304,5	500,6	25,1	171,9	62,5
36-60	283,0	53,1	13,0	250,0	15,1	8,0	25,0
61-90	5,8	20,3	13,4	3,8	6,9	2,0	0,0
91-180	28,5	50,0	0,0	0,0	24,0	2,5	26,0
>180	30,2	446,9	440,0	26,0	4,9	2,2	2,0
Total	1613,8	1493,5	1229,9	1218,4	82,6	214,4	181,0

^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	15.15%	15.40%	14.80%	15.05%
15-35	14.81%	14.64%	14.85%	14.77%
36-60	12.51%	13.85%	12.33%	12.90%
61-90	–	11.75%	11.49%	11.69%
91-180	10.60%	9.92%	9.39%	10.23%
>180	8.04%	8.19%	7.61%	8.05%
Total	13.94%	14.13%	14.60%	14.34%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	32	181	4380	4843	25	250	7978	9406	25	152	3354	3880
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3014	2529	0	0	4447	3365	0	0	2765	1855
Otros ^c	181	32	524	536	250	25	1815	1469	152	25	273	656
Total	213	213	7918	7908	275	275	14240	14240	177	177	6392	6391

^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.