

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de junio de 2023
Fecha de Información: 22 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\$3478 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 12.02%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	551,4	519,0	352,0	396,1	24,0	12,4	143,0
15-35	1019,6	825,7	517,0	587,6	15,7	139,0	293,0
36-60	5,7	9,5	0,0	0,0	9,1	5,4	0,4
61-90	59,1	49,4	11,6	22,8	27,8	26,3	10,0
91-180	81,0	426,4	367,0	70,0	49,4	1,0	10,0
>180	174,0	259,1	194,5	125,5	18,6	2,5	46,0
Total	1890,9	2089,3	1442,1	1202,0	144,8	186,5	502,4

^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	13.09%	12.57%	10.95%	12.17%
15-35	13.05%	13.33%	13.11%	13.16%
36-60	13.00%	12.76%	10.94%	12.11%
61-90	10.98%	10.74%	10.72%	10.76%
91-180	8.85%	9.42%	9.51%	9.40%
>180	7.83%	8.39%	7.29%	8.06%
Total	12.46%	11.86%	11.86%	12.02%

^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	23	113	2971	3391	28	262	8296	9783	25	153	3423	4056
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2305	1836	0	0	4676	3539	0	0	2872	1855
Otros ^c	113	23	234	274	262	28	1824	1473	153	25	274	658
Total	136	136	5510	5501	290	290	14796	14795	178	178	6569	6569

^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.