

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de julio de 2023
Fecha de Información: 30 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\$4069 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.79%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	821,3	456,5	239,2	553,9	17,8	67,8	199,5
15-35	1121,4	1105,8	665,9	691,6	68,2	58,2	371,7
36-60	5,4	69,4	61,0	0,0	8,4	5,4	0,0
61-90	191,4	105,5	18,9	109,9	6,6	1,5	80,0
91-180	36,0	256,5	187,5	25,0	59,0	1,0	10,0
>180	222,8	413,1	337,0	147,8	1,1	0,1	75,0
Total	2398,3	2406,8	1509,5	1528,1	161,2	134,0	736,1

^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	9.35%		11.33%	7.89%	9.09%
15-35	11.42%		10.07%	10.16%	10.47%
36-60	-		11.46%	10.89%	11.24%
61-90	10.55%		9.99%	9.93%	10.42%
91-180	9.50%		8.79%	9.14%	8.90%
>180	8.33%		8.09%	7.42%	7.96%
Total	10.43%		10.02%	9.03%	9.79%

^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

Sector	26 – 30 jun.				03 - 07 jul.				10 - 14 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	10	59	2153	2339	47	168	4500	5513	88	220	6277	5773
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	1337	1090	0	0	3586	2626	0	0	3097	2582
Otros ^c	59	10	244	306	168	47	734	679	220	88	449	1464
Total	69	69	3734	3735	215	215	8820	8818	308	308	9823	9819

^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.