

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de julio de 2023
Fecha de Información: 05 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\$5065 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.08%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	1088,8	1292,0	299,4	780,9	699,1	14,4	293,5
15-35	647,4	1121,0	880,3	353,7	37,2	90,1	203,6
36-60	658,3	12,0	0,0	40,0	12,0	618,3	0,0
61-90	26,4	25,0	0,0	9,1	19,0	11,4	6,0
91-180	46,1	206,3	84,0	0,0	80,8	4,6	41,5
>180	255,2	248,7	217,5	184,5	13,5	52,9	17,7
Total	2722,2	2905,0	1481,2	1368,2	861,5	791,7	562,3

^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	11.57%	9.21%	8.18%	9.15%
15-35	11.78%	11.49%	11.67%	11.58%
36-60	—	11.25%	10.57%	10.59%
61-90	10.19%	9.82%	9.80%	9.87%
91-180	9.42%	9.01%	9.23%	9.14%
>180	8.23%	8.25%	8.33%	8.28%
Total	11.37%	10.12%	9.63%	10.08%

^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	03 – 07 jul.				10 - 14 jul.				17 - 21 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	47	169	5445	5783	90	232	6659	6711	23	223	5728	6266
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3666	3299	0	0	3180	2783	0	0	4336	2646
Otros ^c	169	47	753	782	232	90	1130	1468	223	23	398	1546
Total	216	216	9864	9864	322	322	10969	10962	246	246	10462	10458

^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.