

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2023
Fecha de Información: 07 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\$2384 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.46%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	393,3	389,5	215,0	205	23,5	37,3	151,0
15-35	874,0	817,6	429,5	477	53,0	61,9	335,1
36-60	54,1	30,1	0,0	32	30,1	22,1	0,0
61-90	35,2	19,0	0,0	0	9,0	25,2	10,0
91-180	4,6	50,8	0,0	0	50,8	4,6	0,0
>180	52,6	183,8	140,0	25	18,8	2,6	25,0
Total	1413,8	1490,9	784,5	739	185,4	153,7	521,1

^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	11.38%	11.37%	11.23%	11.33%
15-35	11.29%	10.03%	10.24%	10.45%
36-60	–	10.94%	10.68%	10.77%
61-90	10.41%	10.18%	9.97%	10.11%
91-180	–	9.05%	9.19%	9.06%
>180	8.49%	7.41%	6.22%	7.58%
Total	11.17%	10.00%	10.50%	10.46%

^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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (365/Plazo)) - 1$. 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	7	52	965	956	99	250	7065	7424	26	228	5965	6703
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	559	584	0	0	3403	2976	0	0	4659	2760
Otros ^c	52	7	73	57	250	99	1444	1506	228	26	406	1562
Total	59	59	1597	1597	349	349	11912	11906	254	254	11030	11025

^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.