

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de julio de 2023
Fecha de Información: 10 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\$3358 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.42%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	436,8	963,4	361,7	372,8	550,2	12,5	51,5
15-35	661,1	526,0	314,8	449,0	17,1	18,0	194,1
36-60	504,4	25,3	0,0	66,0	15,3	428,4	10,0
61-90	12,1	3,1	0,0	0,0	3,1	12,1	0,0
91-180	167,7	213,6	177,7	25,0	15,9	122,7	20,0
>180	41,8	88,5	72,5	29,7	6,0	2,1	10,0
Total	1824,0	1819,9	926,7	942,5	607,6	595,9	285,6

^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	11.02%		5.29%	10.37%	6.69%
15-35	9.90%		11.01%	10.01%	10.19%
36-60	10.02%		11.13%	9.19%	9.27%
61-90	-		10.08%	9.68%	9.76%
91-180	9.22%		8.70%	9.19%	8.93%
>180	8.40%		7.89%	6.65%	7.83%
Total	10.00%		6.72%	9.64%	8.42%

^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	10 – 14 jul.				17 - 21 jul.				24 - 28 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	99	254	7441	7680	27	228	6048	7347	116	313	7787	6501
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3609	3266	0	0	4756	2831	0	0	3215	3506
Otros ^c	254	99	1450	1547	228	27	947	1567	313	116	835	1824
Total	353	353	12500	12493	255	255	11751	11745	429	429	11837	11831

^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.