

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de julio de 2023
Fecha de Información: 11 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\$4183 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.90%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	612,6	936,0	463,4	507,6	398,6	31,0	74,0
15-35	362,9	626,6	495,0	180,8	25,5	76,0	106,1
36-60	64,2	13,3	1,0	29,5	12,2	34,7	0,0
61-90	447,7	30,3	11,7	54,5	3,6	378,2	15,0
91-180	294,4	325,1	310,5	285,0	9,6	4,4	5,0
>180	384,6	359,4	281,8	305,6	3,6	5,0	74,0
Total	2166,4	2290,7	1563,4	1363,0	453,1	529,4	274,1

^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	10.72%		9.59%	10.44%	9.95%
15-35	10.57%		10.50%	10.24%	10.43%
36-60	-		10.45%	10.25%	10.29%
61-90	9.66%		9.75%	9.43%	9.44%
91-180	9.07%		9.06%	8.99%	9.03%
>180	7.47%		8.21%	7.64%	7.67%
Total	9.69%		9.85%	10.00%	9.90%

^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

Sector	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	96	218	7240	7385	28	229	6241	7898	117	314	7852	6825
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	3582	3345	0	0	4883	2984	0	0	3517	3537
Otros ^c	218	96	1404	1492	229	28	1334	1569	314	117	847	1847
Total	314	314	12226	12222	257	257	12458	12451	431	431	12216	12209

^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.