

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2023
Fecha de Información: 12 de mayo 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\$3567 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.36%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	271,5	531,7	290,6	145,5	132,0	17,0	109,0
15-35	1261,5	1531,6	970,8	721,5	27,8	7,0	533,0
36-60	48,9	61,5	44,8	0,0	14,7	46,9	2,0
61-90	34,3	31,7	20,0	30,0	7,8	0,5	3,9
91-180	127,9	60,1	20,0	55,4	37,2	69,6	3,0
>180	217,3	75,0	30,0	182,0	10,0	0,3	35,0
Total	1961,5	2291,5	1376,2	1134,4	229,5	141,2	685,8

^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	8.97%	6.99%	Inf%	7.57%
15-35	8.86%	8.90%	8.53%	8.74%
36-60	8.26%	8.54%	8.42%	8.48%
61-90	8.02%	8.44%	8.12%	8.36%
91-180	7.95%	8.20%	8.19%	8.19%
>180	7.76%	8.22%	7.49%	7.63%
Total	8.81%	8.05%	8.34%	8.36%

^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	08 – 12 may.				15 - 19 may.				22 - 26 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	17	48	993	1073	31	230	9895	10898	34	282	5833	5688
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	431	431	0	0	6276	5441	0	0	3034	2208
Otros ^c	48	17	152	64	230	31	1673	1489	282	30	509	1458
Total	65	65	1576	1568	261	261	17844	17828	316	312	9376	9354

^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.