

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2023
Fecha de Información: 15 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\$3476 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.96%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1009,2	1114,3	918,0	778,0	61,7	96,6	134,6
15-35	673,2	871,0	448,9	355,2	112,5	8,4	309,6
36-60	133,4	59,5	0,1	108,8	44,3	9,6	15,0
61-90	0,5	7,2	0,6	0,0	6,6	0,5	0,0
91-180	0,3	46,6	21,7	0,0	24,9	0,3	0,0
>180	15,1	9,8	0,0	10,0	4,8	0,1	5,0
Total	1831,6	2108,4	1389,3	1252,0	254,9	115,4	464,2

^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	8.91%		8.81%	6.90%	8.02%
15-35	8.94%		7.77%	6.66%	7.86%
36-60	8.42%		8.56%	8.58%	8.55%
61-90	-		8.41%	8.27%	8.40%
91-180	-		7.81%	8.15%	7.82%
>180	7.85%		7.90%	7.79%	7.84%
Total	8.90%		8.11%	6.98%	7.96%

^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	15 – 19 may.				22 - 26 may.				29 may. - 02 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	37	231	10830	11725	38	284	5943	5986	199	282	5011	5067
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6918	6089	0	0	3242	2234	0	0	2631	2050
Otros ^c	231	37	1746	1664	284	34	518	1462	282	199	671	1184
Total	268	268	19494	19478	322	318	9703	9682	481	481	8313	8301

^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.