

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2023
Fecha de Información: 16 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\$4795 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.27%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	701,6	1738,2	671,5	283,4	670,7	22,2	396,0
15-35	1326,2	1015,4	301,1	535,2	7,3	84,0	707,0
36-60	643,2	46,7	0,5	40,0	16,2	573,2	30,0
61-90	96,6	15,3	0,0	35,0	10,2	56,5	5,1
91-180	178,9	138,1	4,6	50,0	6,4	1,7	127,2
>180	155,9	138,9	0,5	15,0	3,3	5,8	135,1
Total	3102,4	3092,7	978,2	958,6	714,1	743,4	1400,4

^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	9.08%		6.60%	8.95%	7.60%
15-35	9.29%		9.26%	9.12%	9.25%
36-60	8.50%		9.12%	8.05%	8.10%
61-90	8.25%		8.57%	8.29%	8.33%
91-180	8.24%		8.43%	8.27%	8.25%
>180	8.08%		8.06%	8.00%	8.07%
Total	9.00%		7.23%	8.43%	8.27%

^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	31	182	9523	10553	38	285	6158	6975	199	282	5081	5113
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	6415	5431	0	0	3400	2273	0	0	2671	2109
Otros ^c	182	31	1547	1484	285	35	1178	1466	282	199	677	1196
Total	213	213	17485	17468	323	320	10736	10714	481	481	8429	8418

^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.