

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2023
Fecha de Información: 17 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\$3956 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.51%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	910,6	998,8	105,0	437,4	439,3	18,7	454,5
15-35	755,1	1350,8	820,1	249,0	40,7	16,1	490,0
36-60	10,1	41,2	24,5	0,0	16,6	10,0	0,1
61-90	488,1	82,0	50,0	45,0	12,0	423,1	20,0
91-180	157,5	62,9	10,2	145,2	42,7	2,3	10,0
>180	44,5	49,3	0,0	15,0	29,3	9,5	20,0
Total	2365,9	2585,0	1009,8	891,7	580,6	479,6	994,6

^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	9.60%		5.75%	8.67%	7.82%
15-35	9.60%		9.56%	9.53%	9.57%
36-60	8.80%		9.02%	8.80%	8.97%
61-90	8.56%		8.73%	7.68%	7.80%
91-180	8.38%		8.56%	8.37%	8.44%
>180	8.08%		8.20%	7.53%	7.98%
Total	9.54%		7.81%	8.33%	8.51%

^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	24	156	8108	8659	39	285	6463	7142	199	286	5301	5769
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5533	4827	0	0	3407	2420	0	0	2696	2119
Otros ^c	156	24	932	1076	285	35	1182	1468	286	199	1108	1206
Total	180	180	14573	14562	324	320	11052	11030	485	485	9105	9094

^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.