

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2023
Fecha de Información: 18 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\$2694 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.50%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	642,7	344,2	260,4	562,9	9,1	5,1	74,8
15-35	677,7	907,0	630,5	342,7	9,5	68,0	267,0
36-60	21,5	27,8	0,0	0,0	7,8	1,5	20,0
61-90	63,0	29,6	1,3	0,0	5,9	40,5	22,5
91-180	2,7	34,0	10,0	0,0	22,4	1,0	1,7
>180	102,0	267,3	182,5	57,5	44,8	4,5	40,0
Total	1509,6	1609,9	1084,6	963,1	99,4	120,7	425,9

^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	9.66%		9.59%	5.57%	7.04%
15-35	9.76%		8.81%	9.64%	9.31%
36-60	9.65%		9.42%	9.06%	9.56%
61-90	9.03%		8.83%	8.60%	8.76%
91-180	8.24%		8.51%	8.10%	8.47%
>180	8.35%		7.98%	8.09%	8.15%
Total	9.56%		8.86%	7.15%	8.50%

^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	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	15	106	6143	6388	39	285	6710	7261	199	286	5404	5811
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4280	3835	0	0	3507	2650	0	0	2715	2200
Otros ^c	106	15	494	683	285	36	1185	1470	286	199	1112	1208
Total	121	121	10917	10906	324	321	11402	11381	485	485	9231	9219

^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.