

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2023
Fecha de Información: 19 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\$3012 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.13%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	640,1	501,6	123,7	498,5	256,9	20,6	121,0
15-35	554,5	589,9	462,7	276,2	14,6	165,8	112,5
36-60	29,1	74,6	50,0	0,0	5,6	10,1	19,0
61-90	10,2	11,3	0,0	0,2	7,6	6,2	3,7
91-180	3,7	13,2	4,7	0,0	4,9	0,1	3,6
>180	218,0	625,7	621,3	210,0	4,4	8,0	0,0
Total	1455,5	1816,4	1262,5	984,9	294,0	210,7	259,8

^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	10.14%		8.08%	5.83%	8.08%
15-35	10.01%		10.17%	9.05%	9.73%
36-60	9.88%		10.36%	9.55%	10.16%
61-90	9.03%		9.02%	8.99%	9.01%
91-180	8.32%		8.69%	8.39%	8.55%
>180	-		8.46%	7.95%	8.35%
Total	10.02%		9.35%	8.24%	9.13%

^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	10	60	1943	2235	43	295	6898	7431	202	286	5825	6167
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1418	1101	0	0	3641	2802	0	0	2730	2512
Otros ^c	60	10	156	173	295	39	1191	1475	286	202	1353	1219
Total	70	70	3517	3509	338	334	11730	11708	488	488	9908	9898

^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.