

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2023
Fecha de Información: 23 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\$3286 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.34%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	654,1	621,3	449,0	504,4	39,9	17,2	132,5
15-35	494,0	829,1	685,7	348,6	38,4	0,0	145,3
36-60	373,5	134,9	107,5	368,0	27,4	5,5	0,0
61-90	10,0	33,0	0,0	0,0	29,1	6,0	4,0
91-180	74,9	43,5	5,9	74,5	37,7	0,4	0,0
>180	137,7	172,1	116,0	125,5	46,1	2,2	10,0
Total	1744,2	1834,0	1364,0	1421,0	218,5	31,4	291,8

^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	10.79%	10.66%	9.73%	10.28%
15-35	10.70%	10.83%	10.66%	10.77%
36-60	–	10.51%	10.08%	10.16%
61-90	9.43%	11.36%	8.61%	10.74%
91-180	–	8.99%	9.19%	9.05%
>180	8.07%	8.34%	7.94%	8.23%
Total	10.62%	10.51%	9.98%	10.34%

^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	22 – 26 may.				29 may. - 02 jun.				05 - 09 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	45	294	7499	7815	202	288	6037	6365	19	161	5355	6007
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3977	3319	0	0	2830	2650	0	0	3696	2855
Otros ^c	294	42	1195	1515	288	202	1386	1227	161	19	310	499
Total	339	336	12671	12649	490	490	10253	10242	180	180	9361	9361

^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.