

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de mayo de 2023
Fecha de Información: 24 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\$2499 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.47%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	624,1	375,5	164,0	546,5	143,9	10,0	67,6
15-35	662,3	829,0	387,5	259,0	88,3	0,0	403,4
36-60	126,9	24,5	0,0	0,0	24,5	126,9	0,0
61-90	94,8	55,3	0,3	65,0	34,7	9,4	20,4
91-180	24,9	46,5	0,0	20,0	46,0	4,4	0,5
>180	17,7	119,9	93,3	7,5	16,7	0,1	10,0
Total	1550,6	1450,7	645,1	898,0	354,0	150,7	501,9

^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	10.57%	10.45%	10.69%	10.60%
15-35	10.70%	10.99%	10.61%	10.80%
36-60	–	10.46%	9.95%	10.03%
61-90	9.94%	9.86%	9.88%	9.89%
91-180	8.77%	9.16%	9.17%	9.16%
>180	8.13%	8.49%	7.99%	8.43%
Total	10.59%	10.41%	10.46%	10.47%

^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	21	250	5396	5661	204	293	6334	6572	19	165	5594	6172
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3153	2944	0	0	2900	2922	0	0	3717	2962
Otros ^c	250	21	466	398	293	204	1501	1231	165	19	326	504
Total	271	271	9015	9003	497	497	10735	10725	184	184	9637	9638

^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.