

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de mayo de 2023
Fecha de Información: 26 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\$3505 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.61%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	592,7	689,5	236,8	223,0	162,2	79,2	290,5
15-35	1141,0	1002,0	310,7	494,3	112,8	68,2	578,5
36-60	70,4	32,9	0,0	68,8	32,9	1,7	0,0
61-90	27,8	45,0	0,0	2,2	25,0	5,6	20,0
91-180	205,6	45,1	5,9	70,0	34,2	130,6	5,0
>180	306,8	524,9	220,0	20,0	19,9	1,8	285,0
Total	2344,3	2339,5	773,4	878,3	387,1	287,0	1179,0

^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	10.56%		9.78%	5.95%	8.82%
15-35	10.56%		10.53%	10.51%	10.54%
36-60	-		9.77%	10.01%	9.79%
61-90	10.05%		9.66%	9.78%	9.83%
91-180	9.23%		9.14%	9.26%	9.24%
>180	8.66%		8.64%	8.38%	8.64%
Total	10.09%		9.78%	8.81%	9.61%

^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	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	8	115	1565	1665	136	309	6748	6987	85	167	6142	6801
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1010	1073	0	0	3114	3180	0	0	3906	3079
Otros ^c	115	8	261	92	309	136	1627	1312	167	85	355	523
Total	123	123	2836	2830	445	445	11489	11479	252	252	10403	10403

^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.