

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2023
Fecha de Información: 29 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\$457 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.99%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	163,3	96,0	25	5,0	8,0	95,3	63
15-35	101,2	184,1	11	33,2	110,1	5,0	63
36-60	0,4	5,5	0	0,0	5,5	0,4	0
61-90	4,3	3,6	0	0,0	3,6	4,3	0
91-180	0,5	19,3	0	0,0	19,3	0,5	0
>180	0,1	4,6	0	0,0	4,6	0,1	0
Total	269,9	313,2	36	38,2	151,2	105,7	126

^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	10.51%		12.41%	4.90%	7.33%
15-35	10.50%		10.44%	10.17%	10.45%
36-60	-		10.56%	10.22%	10.54%
61-90	-		10.09%	7.27%	8.55%
91-180	-		9.06%	8.53%	9.05%
>180	-		8.55%	8.35%	8.54%
Total	10.51%		10.32%	5.36%	8.99%

^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	29 may. - 02 jun.				05 - 09 jun.				12 - 16 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	138	312	6816	7040	86	169	6143	6805	103	216	7854	8186
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3164	3145	0	0	3906	3080	0	0	4289	3089
Otros ^c	312	138	1629	1414	169	86	359	523	216	103	517	1192
Total	450	450	11609	11599	255	255	10408	10408	319	319	12660	12467

^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.