

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de junio de 2023
Fecha de Información: 30 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\$4085 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.58%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	499,7	769,2	418,6	293,9	207,8	63,0	142,8
15-35	952,8	1109,2	273,0	412,1	368,0	72,5	468,2
36-60	477,1	65,6	30,3	192,2	35,3	284,9	0,0
61-90	25,2	40,0	0,0	0,0	40,0	25,2	0,0
91-180	269,3	177,9	11,0	75,2	96,9	124,1	70,0
>180	229,3	163,2	88,0	156,2	63,2	61,0	12,0
Total	2453,3	2325,1	820,9	1129,6	811,1	630,7	693,0

^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	10.52%		9.93%	10.72%	10.31%
15-35	10.25%		8.09%	10.55%	9.54%
36-60	-		10.33%	9.07%	9.27%
61-90	-		9.96%	9.80%	9.90%
91-180	9.03%		9.04%	9.18%	9.10%
>180	8.64%		8.70%	7.92%	8.28%
Total	10.16%		9.03%	9.77%	9.58%

^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

Sector	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	139	313	7100	7318	87	176	6346	7314	105	220	8027	8543
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	3414	3368	0	0	4057	3117	0	0	4315	3143
Otros ^c	312	139	1638	1455	176	87	554	526	220	105	756	1219
Total	451	452	12152	12141	263	263	10957	10957	325	325	13098	12905

^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.