

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de junio de 2023
Fecha de Información: 31 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\$4228 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.11%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	968,6	746,7	343,3	679,6	150,6	0,0	289,0
15-35	1034,8	1384,8	737,7	439,8	0,0	15,2	579,7
36-60	22,3	51,8	0,0	0,0	51,8	22,3	0,0
61-90	137,1	17,8	0,0	98,5	12,8	33,6	5,0
91-180	236,4	40,1	0,0	117,0	6,9	86,2	33,2
>180	219,1	290,6	264,0	137,0	11,8	67,3	14,8
Total	2618,3	2531,9	1345,0	1472,0	234,0	224,6	921,8

^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	10.61%	10.32%	8.98%	9.78%
15-35	10.58%	10.81%	10.44%	10.65%
36-60	–	10.29%	10.09%	10.23%
61-90	9.83%	9.85%	9.55%	9.65%
91-180	8.93%	9.06%	8.95%	8.95%
>180	7.86%	8.35%	8.48%	8.37%
Total	10.48%	10.58%	9.36%	10.11%

^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	52	208	5419	5249	89	176	6690	7736	107	222	8367	8901
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3038	3218	0	0	4234	3357	0	0	4389	3192
Otros ^c	208	52	413	397	176	89	700	531	222	107	759	1229
Total	260	260	8870	8864	265	265	11624	11624	329	329	13515	13322

^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.