

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de junio de 2023
Fecha de Información: 01 de junio 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\$4215 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.16%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	559,3	728,8	91,4	124,5	223,2	20,5	414,2
15-35	1017,1	1663,8	357,0	284,1	716,3	142,5	590,5
36-60	800,9	135,5	0,0	0,0	25,5	690,9	110,0
61-90	155,8	43,7	4,9	122,0	8,8	3,8	30,0
91-180	82,6	90,7	50,0	0,0	20,7	62,6	20,0
>180	56,8	92,9	25,0	2,3	19,9	6,5	48,0
Total	2672,5	2755,4	528,3	532,9	1014,3	926,9	1212,8

^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	10.52%		9.21%	9.94%	9.99%
15-35	10.46%		4.79%	10.38%	7.65%
36-60	9.92%		10.27%	6.67%	7.22%
61-90	9.53%		9.54%	9.45%	9.48%
91-180	9.00%		8.69%	9.02%	8.86%
>180	8.35%		8.26%	7.38%	8.22%
Total	10.30%		6.12%	8.27%	8.16%

^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	36	73	3473	3473	92	177	6946	8011	108	223	8687	9509
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2080	2148	0	0	4266	3430	0	0	4411	3257
Otros ^c	73	36	220	147	177	92	765	535	223	108	1099	1239
Total	109	109	5773	5768	269	269	11977	11976	331	331	14197	14005

^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.