

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de junio de 2023
Fecha de Información: 09 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\$6465 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.00%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	760,4	1188,3	772,6	449,9	130,7	25,5	285,0
15-35	1503,7	1086,3	575,4	997,6	39,8	0,0	506,2
36-60	122,2	13,5	0,0	44,2	13,5	77,9	0,0
61-90	16,6	62,7	47,1	0,3	15,6	16,3	0,0
91-180	745,1	191,4	30,0	618,0	46,4	12,1	115,0
>180	521,9	1372,6	1117,0	307,0	42,1	1,4	213,5
Total	3669,9	3914,7	2542,1	2417,0	287,9	133,3	1119,7

^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	9.77%		8.78%	8.70%	8.99%
15-35	9.73%		9.79%	9.43%	9.64%
36-60	-		9.42%	9.24%	9.27%
61-90	-		8.91%	8.65%	8.78%
91-180	8.09%		8.33%	8.16%	8.18%
>180	7.67%		7.82%	7.50%	7.70%
Total	9.16%		8.91%	8.95%	9.00%

^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	05 – 09 jun.				12 - 16 jun.				19 - 23 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	13	51	805	1106	127	253	11529	12480	21	215	5101	5541
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	513	195	0	0	6038	5187	0	0	2643	2310
Otros ^c	51	13	56	73	253	127	1575	1282	215	21	1085	968
Total	64	64	1374	1374	380	380	19142	18949	236	236	8829	8819

^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.