

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de mayo de 2023
Fecha de Información: 03 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\$3248 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.16%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	533,8	770,5	96,1	277,8	429,9	11,5	244,5
15-35	598,0	976,6	597,1	218,3	18,0	18,2	361,5
36-60	420,3	42,3	20,3	0,0	12,0	410,3	10,0
61-90	8,5	7,6	0,0	0,0	7,6	8,5	0,0
91-180	238,5	190,5	35,0	100,0	25,5	0,0	138,5
>180	130,9	148,6	69,0	65,8	15,6	1,1	64,0
Total	1929,9	2136,1	817,4	661,9	508,7	449,6	818,5

^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	9.13%	5.72%	8.98%	7.28%
15-35	9.16%	8.78%	8.98%	8.95%
36-60	8.62%	8.80%	8.26%	8.30%
61-90	–	8.54%	8.24%	8.38%
91-180	8.25%	8.37%	7.65%	8.03%
>180	7.87%	7.86%	7.93%	7.88%
Total	8.90%	7.37%	8.41%	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	01 – 05 may.				08 - 12 may.				15 - 19 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	31	100	3638	3128	36	157	7503	8090	25	224	7589	7885
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1586	2032	0	0	4171	3263	0	0	5328	4126
Otros ^c	100	31	358	408	157	36	1091	1392	224	25	511	1406
Total	131	131	5582	5568	193	193	12765	12745	249	249	13428	13417

^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.