

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de mayo de 2023
Fecha de Información: 05 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\$1872 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.80%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	371,2	317,3	76,2	152,7	32,4	10,0	208,6
15-35	558,7	468,9	335,0	394,9	21,0	50,8	113,0
36-60	16,5	68,7	40,6	4,1	28,1	12,4	0,0
61-90	13,0	27,0	3,5	10,0	23,5	3,0	0,0
91-180	71,1	87,5	25,0	55,0	48,5	2,1	14,0
>180	150,4	62,4	45,6	138,5	11,8	6,9	5,0
Total	1181,0	1031,8	525,8	755,2	165,3	85,1	340,6

^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	9.06%	8.85%	8.77%	8.95%
15-35	9.06%	9.11%	8.86%	8.97%
36-60	–	9.02%	8.74%	8.93%
61-90	–	8.72%	8.17%	8.67%
91-180	8.32%	8.25%	7.81%	8.25%
>180	8.08%	7.85%	7.97%	7.94%
Total	9.02%	8.82%	8.65%	8.80%

^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	10	50	598	387	40	166	7885	8477	27	221	8135	8269
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	123	358	0	0	4363	3446	0	0	5467	4403
Otros ^c	50	10	66	32	166	40	1118	1424	221	27	536	1449
Total	60	60	787	777	206	206	13366	13347	248	248	14138	14121

^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.