

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2023
Fecha de Información: 08 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\$3500 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.82%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	700,2	862,5	338,0	542,8	386,0	18,9	138,5
15-35	505,0	791,0	627,7	305,0	31,0	67,7	132,3
36-60	373,2	29,1	5,0	102,0	24,0	271,2	0,0
61-90	46,3	18,1	0,2	45,0	17,3	0,7	0,6
91-180	30,0	64,1	19,7	30,0	44,4	0,0	0,0
>180	171,9	198,3	136,5	151,2	43,8	2,7	18,0
Total	1826,5	1963,1	1127,2	1176,0	546,5	361,1	289,4

^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	8.92%		7.09%	6.36%	7.02%
15-35	8.91%		8.25%	8.95%	8.55%
36-60	-		9.15%	8.25%	8.32%
61-90	8.60%		8.82%	8.73%	8.75%
91-180	-		8.45%	-	8.45%
>180	7.92%		7.85%	7.74%	7.85%
Total	8.85%		7.77%	7.59%	7.82%

^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	08 – 12 may.				15 - 19 may.				22 - 26 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	42	163	8156	8593	27	224	8647	9072	32	271	5267	4585
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4418	3653	0	0	5708	4723	0	0	2252	2002
Otros ^c	163	42	1126	1433	224	27	912	1456	271	28	501	1421
Total	205	205	13700	13679	251	251	15267	15251	303	299	8020	8008

^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.