

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de mayo de 2023
Fecha de Información: 09 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\$3328 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.34%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	684,0	863,3	302,6	411,1	0,0	7,7	265,1
15-35	790,2	853,7	443,5	274,2	33,2	0,0	516,0
36-60	260,5	134,0	80,7	17,5	18,2	207,9	35,1
61-90	7,2	7,8	0,0	0,0	7,8	7,2	0,0
91-180	45,3	59,5	0,0	0,0	14,5	0,3	45,0
>180	472,1	427,2	10,0	52,9	1,2	3,2	416,0
Total	2259,3	2345,5	836,8	755,7	74,9	226,4	1277,2

^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	8.93%	8.29%	6.81%	8.02%
15-35	8.91%	8.75%	8.40%	8.69%
36-60	8.82%	8.77%	8.58%	8.63%
61-90	–	8.58%	8.47%	8.53%
91-180	8.20%	8.47%	7.70%	8.26%
>180	7.98%	8.13%	7.85%	7.97%
Total	8.54%	8.52%	7.89%	8.34%

^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	41	137	6564	6988	28	221	8890	9594	32	271	5436	4766
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3676	3069	0	0	5830	4793	0	0	2357	2080
Otros ^c	137	40	974	1146	221	28	1141	1457	271	29	501	1435
Total	178	177	11214	11203	249	249	15861	15844	303	300	8294	8281

^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.