

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de junio de 2023
Fecha de Información: 05 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\$4027 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.80%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	658,6	635,8	243,3	438,7	196,3	23,7	196,2
15-35	1105,6	600,9	334,1	848,0	36,8	27,6	230,0
36-60	170,4	577,6	485,0	5,0	62,6	135,4	30,0
61-90	2,2	49,8	30,0	0,0	19,8	2,2	0,0
91-180	195,7	149,1	68,1	174,0	61,0	1,7	20,0
>180	189,8	177,8	145,4	177,0	22,5	2,8	10,0
Total	2322,3	2190,9	1305,8	1642,7	398,8	193,4	486,3

^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	10.27%		9.90%	10.18%	10.09%
15-35	10.13%		10.62%	10.14%	10.30%
36-60	9.89%		9.97%	9.44%	9.64%
61-90	-		9.03%	9.04%	9.03%
91-180	8.62%		8.65%	8.54%	8.61%
>180	7.94%		7.93%	7.72%	7.83%
Total	10.07%		9.75%	9.70%	9.80%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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	99	187	7917	8418	112	234	9506	10641	17	212	4510	4134
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4449	4100	0	0	4845	3607	0	0	1896	2163
Otros ^c	187	99	775	608	234	112	1343	1254	212	17	838	937
Total	286	286	13141	13126	346	346	15694	15502	229	229	7244	7234

^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.