

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de junio de 2023
Fecha de Información: 06 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\$4473 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.57%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	1173,1	891,7	437,3	812,0	107,9	14,6	346,5
15-35	592,4	1202,4	480,6	207,5	353,9	16,9	368,0
36-60	200,7	45,5	0,0	0,0	25,5	180,7	20,0
61-90	66,2	18,5	0,0	51,0	18,5	15,2	0,0
91-180	422,3	357,9	131,6	57,1	36,3	175,3	190,0
>180	247,9	350,3	120,2	75,5	58,0	0,4	172,0
Total	2702,7	2866,4	1169,8	1203,1	600,1	403,1	1096,5

^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	9.75%		5.28%	9.01%	8.48%
15-35	9.54%		8.62%	8.82%	8.90%
36-60	8.89%		9.76%	9.06%	9.12%
61-90	-		9.03%	8.66%	8.74%
91-180	8.46%		8.49%	7.31%	8.01%
>180	8.00%		7.61%	8.07%	7.91%
Total	9.17%		8.03%	8.60%	8.57%

^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	34	148	7232	7533	112	245	9830	11047	17	213	4629	4440
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4106	4085	0	0	5041	3809	0	0	1982	2163
Otros ^c	148	34	684	396	245	112	1437	1258	213	17	947	946
Total	182	182	12022	12014	357	357	16308	16114	230	230	7558	7549

^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.