

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de junio de 2023
Fecha de Información: 07 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\$5509 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.83%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	458,6	534,2	358,1	304,1	42,2	20,5	134,0
15-35	594,5	2161,3	1859,6	333,1	71,2	30,8	230,5
36-60	289,9	23,5	0,0	287,5	23,3	2,2	0,2
61-90	86,5	17,5	0,0	71,5	17,5	15,0	0,0
91-180	296,9	225,0	31,9	127,8	33,1	9,1	160,0
>180	1224,4	328,9	84,4	954,0	37,2	63,2	207,2
Total	2950,9	3290,3	2333,9	2078,1	224,4	140,8	732,0

^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	9.65%		8.22%	9.72%	9.17%
15-35	9.23%		9.26%	8.65%	9.10%
36-60	8.90%		9.51%	9.02%	9.46%
61-90	-		8.88%	8.83%	8.86%
91-180	8.33%		8.41%	8.34%	8.34%
>180	7.94%		7.96%	7.85%	7.92%
Total	8.75%		8.84%	8.90%	8.83%

^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	27	121	6051	6264	117	246	10344	11282	19	213	4820	5064
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3749	3615	0	0	5183	4225	0	0	2418	2200
Otros ^c	121	27	295	209	246	117	1437	1265	213	19	988	952
Total	148	148	10095	10088	363	363	16964	16772	232	232	8226	8216

^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.