

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de abril de 2023
Fecha de Información: 30 de marzo 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\$4125 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.64%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	1121,2	213,7	133,0	1047,5	25,3	18,4	55,4
15-35	532,0	1513,4	1331,7	350,7	77,5	77,2	104,1
36-60	251,1	268,8	0,0	0,0	28,8	11,1	240,0
61-90	388,9	266,5	0,0	125,0	26,5	23,9	240,0
91-180	66,6	56,6	2,4	65,8	54,2	0,7	0,0
>180	53,6	32,2	1,8	50,0	30,4	3,6	0,0
Total	2413,4	2351,2	1468,9	1639,0	242,8	134,9	639,5

^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	7.75%		7.17%	7.68%	7.64%
15-35	7.26%		7.76%	7.27%	7.57%
36-60	7.74%		8.06%	7.62%	7.77%
61-90	7.68%		7.94%	7.52%	7.65%
91-180	-		7.98%	7.78%	7.95%
>180	-		7.82%	7.61%	7.75%
Total	7.64%		7.76%	7.52%	7.64%

^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	27 – 31 mar.				03 - 07 abr.				10 - 14 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	32	80	5183	5268	42	99	6284	6729	25	178	8744	9428
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3122	2890	0	0	3178	2839	0	0	4717	3350
Otros ^c	80	32	832	936	99	42	513	396	178	25	908	1574
Total	112	112	9137	9094	141	141	9975	9964	203	203	14369	14352

^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.