

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de abril de 2023
Fecha de Información: 03 de abril 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\$3421 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.09%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	742,2	595,3	149,5	472,4	258,8	82,8	187,0
15-35	758,5	517,8	377,0	643,0	36,3	10,9	104,5
36-60	176,6	96,9	60,0	50,7	21,9	110,9	15,0
61-90	13,3	41,1	1,9	2,7	29,2	0,6	10,0
91-180	158,3	87,6	37,1	0,0	50,5	158,3	0,0
>180	68,6	511,7	450,1	38,0	31,6	0,6	30,0
Total	1917,3	1850,4	1075,6	1206,8	428,2	364,0	346,5

^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	7.89%	7.65%	7.28%	7.50%
15-35	7.81%	7.83%	4.92%	6.25%
36-60	7.78%	7.94%	7.80%	7.83%
61-90	7.77%	7.85%	7.80%	7.83%
91-180	-	7.91%	7.73%	7.78%
>180	7.65%	7.17%	7.46%	7.20%
Total	7.83%	7.57%	6.45%	7.09%

^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	03 – 07 abr.				10 - 14 abr.				17 - 21 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	44	103	6752	6932	32	183	9515	10647	21	177	5005	6506
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3225	3213	0	0	5109	3708	0	0	4068	2120
Otros ^c	103	44	579	401	183	32	1445	1697	177	21	422	858
Total	147	147	10556	10546	215	215	16069	16052	198	198	9495	9484

^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.