

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de abril de 2023
Fecha de Información: 04 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\$4686 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.59%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	645,9	377,0	158,2	422,0	8,6	13,7	210,2
15-35	849,1	1467,8	1104,4	516,7	44,2	13,2	319,2
36-60	20,2	61,8	22,0	0,0	39,8	20,2	0,0
61-90	456,5	39,7	12,0	456,1	27,7	0,4	0,0
91-180	48,3	457,7	389,6	38,1	58,1	0,2	10,0
>180	556,6	244,8	230,7	552,6	14,1	4,0	0,0
Total	2576,6	2648,8	1916,9	1985,5	192,5	51,8	539,4

^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	7.85%	7.74%	6.13%	6.94%
15-35	7.85%	7.80%	7.82%	7.82%
36-60	–	7.99%	7.68%	7.88%
61-90	–	7.97%	7.67%	7.97%
91-180	7.77%	7.97%	7.81%	7.94%
>180	–	7.62%	7.43%	7.62%
Total	7.85%	7.78%	7.17%	7.59%

^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	43	82	6113	5982	33	185	10087	10959	22	179	5028	6572
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2948	2960	0	0	5269	4126	0	0	4118	2120
Otros ^c	82	43	223	335	185	33	1447	1702	179	22	424	866
Total	125	125	9284	9277	218	218	16803	16787	201	201	9570	9558

^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.