

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2023
Fecha de Información: 10 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\$3927 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.67%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	642,7	981,0	232,7	258,1	376,4	0,0	384,6
15-35	1133,3	1539,2	568,6	271,3	118,7	10,0	851,9
36-60	490,7	151,6	42,9	74,0	38,7	346,7	70,0
61-90	4,8	19,1	1,3	4,0	17,9	0,8	0,0
91-180	0,0	108,1	27,4	0,0	80,8	0,0	0,0
>180	56,0	106,7	60,0	56,0	46,7	0,0	0,0
Total	2327,4	2905,9	932,8	663,4	679,1	357,5	1306,5

^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	8.32%		6.19%	7.53%	7.14%
15-35	8.16%		7.73%	7.50%	7.94%
36-60	8.13%		8.26%	7.63%	7.76%
61-90	-		8.04%	7.78%	8.03%
91-180	-		8.03%	-	8.03%
>180	-		7.97%	7.69%	7.93%
Total	8.20%		7.13%	7.58%	7.67%

^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

Sector	10 - 14 abr.				17 - 21 abr.				24 - 28 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	36	195	11234	11774	24	198	5259	7262	33	282	7757	8394
Intragrupa y off-shore ^b	0	0	5745	5003	0	0	4240	2142	0	0	4927	4355
Otros ^c	195	36	1561	1746	198	24	790	872	282	33	856	778
Total	231	231	18540	18523	222	222	10289	10276	315	315	13540	13527

^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.