

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de abril de 2023
Fecha de Información: 11 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\$4200 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.06%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	949,1	420,2	179,7	714,7	0,0	26,9	207,5
15-35	736,3	1466,6	1178,7	474,1	61,9	0,0	262,2
36-60	483,9	91,2	20,8	478,8	70,2	4,9	0,2
61-90	7,0	77,7	7,5	0,0	70,2	7,0	0,0
91-180	79,4	271,6	120,8	20,0	92,8	1,4	58,0
>180	26,7	133,6	70,7	9,3	48,0	2,3	15,0
Total	2282,3	2460,9	1578,1	1697,0	343,0	42,5	542,8

^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	8.63%		7.94%	7.23%	7.67%
15-35	8.37%		8.35%	8.32%	8.35%
36-60	8.28%		8.35%	8.23%	8.31%
61-90	-		8.20%	8.06%	8.19%
91-180	7.95%		8.07%	7.69%	8.02%
>180	7.78%		8.01%	7.80%	7.96%
Total	8.41%		8.24%	7.63%	8.06%

^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

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	30	151	11332	10961	24	205	5514	7411	36	300	7997	8692
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	5284	5161	0	0	4292	2290	0	0	5110	4495
Otros ^c	151	30	1339	1819	205	24	794	884	300	36	874	781
Total	181	181	17955	17941	229	229	10600	10585	336	336	13981	13968

^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.