

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de abril de 2023
Fecha de Información: 12 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\$4101 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.02%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	957,4	463,3	261,1	819,0	0,0	90,4	48,0
15-35	922,7	1115,7	648,1	433,4	113,8	135,5	353,8
36-60	34,8	190,2	135,0	2,5	25,2	2,3	30,0
61-90	19,5	108,3	5,5	0,0	97,8	14,5	5,0
91-180	53,0	215,7	22,0	20,4	163,6	2,6	30,0
>180	314,2	433,2	24,0	13,5	149,2	40,8	260,0
Total	2301,7	2526,3	1095,8	1288,8	549,6	286,0	726,8

^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	8.67%		8.37%	6.90%	7.43%
15-35	8.57%		8.51%	8.30%	8.46%
36-60	8.25%		8.45%	7.98%	8.33%
61-90	8.23%		8.28%	8.23%	8.27%
91-180	8.04%		8.15%	7.58%	8.13%
>180	7.76%		8.00%	7.77%	7.84%
Total	8.25%		8.35%	7.46%	8.02%

^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	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	25	115	8419	7648	25	208	6051	7751	36	307	8077	8951
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4150	4780	0	0	4480	2759	0	0	5352	4567
Otros ^c	115	25	784	916	208	25	884	890	307	36	885	783
Total	140	140	13353	13344	233	233	11415	11400	343	343	14314	14301

^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.