

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de abril de 2023
Fecha de Información: 13 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\$3865 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.81%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	976,4	641,4	475,1	806,9	15,6	18,8	150,6
15-35	899,0	892,3	649,1	680,9	59,8	34,6	183,5
36-60	1,1	14,8	0,0	0,0	14,8	1,1	0,0
61-90	36,9	65,3	10,1	22,0	42,4	2,1	12,8
91-180	83,4	368,5	262,8	35,0	60,7	3,4	45,0
>180	81,5	226,6	147,0	45,8	49,1	5,2	30,5
Total	2078,2	2208,8	1544,1	1590,6	242,3	65,2	422,4

^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	8.57%		7.73%	6.84%	7.40%
15-35	8.45%		8.06%	8.37%	8.25%
36-60	-		8.71%	7.90%	8.66%
61-90	8.21%		8.27%	8.17%	8.24%
91-180	8.00%		8.16%	7.69%	8.08%
>180	7.85%		7.88%	7.66%	7.85%
Total	8.40%		7.94%	7.33%	7.81%

^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	17	81	6319	5679	28	212	6558	8102	37	310	8137	9067
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3427	3823	0	0	4593	3027	0	0	5463	4612
Otros ^c	81	17	366	606	212	28	886	894	310	37	890	792
Total	98	98	10112	10108	240	240	12037	12023	347	347	14490	14471

^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.