

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de abril de 2023
Fecha de Información: 14 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\$2414 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.96%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	629,3	692,0	326,0	329,0	94,9	29,3	271,0
15-35	504,5	593,8	336,0	246,7	52,2	52,1	205,6
36-60	2,1	27,5	0,0	0,0	27,5	2,1	0,0
61-90	3,4	28,2	7,7	0,0	17,5	0,4	3,0
91-180	245,8	272,8	0,0	31,6	59,8	1,2	213,0
>180	39,3	84,4	0,0	13,8	68,4	9,6	16,0
Total	1424,3	1698,7	669,7	621,0	320,4	94,6	708,7

^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	8.54%		8.31%	6.48%	7.75%
15-35	8.51%		7.84%	8.34%	8.16%
36-60	-		8.58%	7.30%	8.49%
61-90	8.19%		8.39%	8.12%	8.36%
91-180	8.04%		8.18%	7.95%	8.07%
>180	7.90%		7.98%	7.73%	7.91%
Total	8.37%		8.10%	7.07%	7.96%

^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

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	7	34	801	773	32	217	6792	8258	37	320	8384	9388
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	348	362	0	0	4613	3183	0	0	5657	4731
Otros ^c	34	7	162	174	217	32	954	904	320	37	904	808
Total	41	41	1311	1309	249	249	12359	12345	357	357	14945	14927

^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.