

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2023
Fecha de Información: 18 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\$2242 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.21%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	383,1	285,7	122,8	214,3	27,8	33,7	135,1
15-35	484,7	833,6	699,9	365,5	30,2	15,7	103,5
36-60	161,8	36,3	0,0	57,0	14,3	82,8	22,0
61-90	13,0	14,9	0,0	0,0	14,9	13,0	0,0
91-180	43,1	45,6	5,4	36,5	35,2	1,6	5,0
>180	50,6	163,3	131,0	29,0	24,3	13,6	8,0
Total	1136,3	1379,4	959,0	702,3	146,7	160,4	273,6

^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	8.56%		8.18%	7.72%	8.10%
15-35	8.41%		8.36%	8.26%	8.36%
36-60	8.32%		8.35%	8.24%	8.27%
61-90	-		8.30%	8.03%	8.17%
91-180	7.97%		8.13%	8.07%	8.11%
>180	7.62%		7.95%	7.72%	7.84%
Total	8.45%		8.27%	7.96%	8.21%

^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	17 – 21 abr.				24 - 28 abr.				01 - 05 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	33	177	6227	7311	39	330	8797	10189	20	105	4500	3131
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4062	2973	0	0	5838	4876	0	0	1807	2352
Otros ^c	177	33	862	855	330	39	1281	831	105	20	369	1178
Total	210	210	11151	11139	369	369	15916	15896	125	125	6676	6661

^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.