

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de abril de 2023
Fecha de Información: 19 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\$5497 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.26%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	1217,0	958,1	750,1	950,8	26,0	84,2	182,0
15-35	1127,3	1623,1	1166,7	653,1	53,1	0,0	474,2
36-60	282,1	158,1	104,4	252,7	32,6	8,4	21,0
61-90	106,6	137,3	70,0	0,0	33,7	73,0	33,6
91-180	240,8	60,0	0,0	232,9	60,0	7,9	0,0
>180	30,2	271,8	230,0	14,8	36,8	10,4	5,0
Total	3003,9	3208,4	2321,3	2104,2	242,3	183,9	715,8

^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	8.61%	8.28%	7.28%	7.60%
15-35	8.73%	8.72%	8.69%	8.72%
36-60	8.59%	8.56%	8.21%	8.52%
61-90	8.09%	8.24%	8.12%	8.14%
91-180	–	7.75%	7.75%	7.75%
>180	7.72%	8.01%	7.44%	7.90%
Total	8.65%	8.57%	7.66%	8.26%

^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	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	27	146	6037	6291	41	331	9180	10787	21	106	4573	3611
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3756	3481	0	0	6362	5169	0	0	2210	2354
Otros ^c	146	27	447	460	331	41	1289	856	106	21	380	1182
Total	173	173	10240	10232	372	372	16831	16812	127	127	7163	7147

^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.