

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de abril de 2023
Fecha de Información: 20 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\$3166 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.23%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	661,0	387,5	287,5	576,1	29,7	14,7	70,2
15-35	1114,8	1199,5	705,6	585,3	16,4	52,0	477,5
36-60	12,0	60,8	0,0	7,9	60,8	4,1	0,0
61-90	55,5	110,3	70,0	35,0	20,3	0,5	20,0
91-180	0,1	36,6	0,0	0,0	36,6	0,1	0,0
>180	16,9	78,8	61,7	12,4	17,1	4,5	0,0
Total	1860,3	1873,5	1124,8	1216,7	180,9	75,9	567,7

^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	8.88%		7.73%	8.40%	8.31%
15-35	8.97%		8.18%	6.98%	8.15%
36-60	-		9.30%	7.78%	9.21%
61-90	8.31%		8.29%	8.41%	8.32%
91-180	-		8.04%	7.95%	8.04%
>180	-		7.89%	7.75%	7.86%
Total	8.93%		8.17%	7.86%	8.23%

^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	13	106	4742	4717	42	333	9842	11012	21	106	4607	3721
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2904	2834	0	0	6492	5751	0	0	2287	2354
Otros ^c	106	13	288	376	333	42	1309	861	106	21	383	1185
Total	119	119	7934	7927	375	375	17643	17624	127	127	7277	7260

^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.