

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de abril de 2023
Fecha de Información: 21 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\$2165 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	744,1	560,0	119,6	343,8	106,5	66,4	333,9
15-35	602,8	818,9	431,6	203,0	19,4	31,8	368,0
36-60	2,4	16,0	0,0	0,0	16,0	2,4	0,0
61-90	11,0	28,0	10,0	0,0	8,0	1,0	10,0
91-180	52,6	21,1	0,0	2,2	21,1	50,4	0,0
>180	7,4	12,5	1,8	7,3	10,7	0,1	0,0
Total	1420,3	1456,6	563,0	556,3	181,7	152,1	711,9

^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	8.95%		8.88%	6.00%	7.82%
15-35	8.89%		8.31%	8.74%	8.63%
36-60	-		8.60%	8.56%	8.60%
61-90	8.54%		8.59%	8.27%	8.56%
91-180	-		7.02%	8.24%	7.89%
>180	-		7.84%	7.77%	7.82%
Total	8.91%		8.44%	7.09%	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sector	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	7	46	424	503	42	337	10299	11270	21	107	4853	3984
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	224	121	0	0	6541	5964	0	0	2348	2468
Otros ^c	46	7	95	116	337	42	1330	916	107	21	464	1196
Total	53	53	743	740	379	379	18170	18150	128	128	7665	7648

^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.