

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de abril de 2023
Fecha de Información: 26 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\$3181 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.14%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	694,8	542,5	195,1	308,8	69,0	107,5	278,5
15-35	802,9	1090,6	553,6	415,3	218,5	69,0	318,6
36-60	278,4	255,4	55,0	0,0	26,4	104,4	174,0
61-90	40,2	48,3	29,1	33,0	19,1	7,2	0,0
91-180	13,1	55,7	0,0	10,0	55,7	3,1	0,0
>180	90,5	57,1	10,0	23,9	29,1	48,6	18,0
Total	1919,9	2049,7	842,8	791,0	417,8	339,8	789,1

^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	8.65%		6.83%	6.24%	7.29%
15-35	8.78%		8.79%	8.29%	8.65%
36-60	8.29%		8.33%	8.70%	8.42%
61-90	-		8.12%	8.29%	8.23%
91-180	-		8.31%	7.98%	8.25%
>180	7.71%		8.05%	7.62%	7.76%
Total	8.60%		8.19%	7.63%	8.14%

^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	24 – 28 abr.				01 - 05 may.				08 - 12 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	33	290	7061	7457	38	107	5780	5205	26	154	6824	6996
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4223	4228	0	0	2675	2964	0	0	3924	2905
Otros ^c	290	33	845	432	107	38	1009	1278	154	26	522	1353
Total	323	323	12129	12117	145	145	9464	9447	180	180	11270	11254

^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.