

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de mayo de 2023
Fecha de Información: 27 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\$2395 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.30%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	321,0	174,7	109,0	153,4	55,9	157,8	9,7
15-35	762,6	1106,4	503,9	255,6	0,0	79,6	427,5
36-60	51,4	38,2	0,0	4,2	16,2	25,2	22,0
61-90	32,8	28,4	0,0	0,0	23,4	27,8	5,0
91-180	38,5	54,0	10,0	16,0	44,0	22,5	0,0
>180	97,8	166,8	66,0	74,8	87,8	10,0	13,0
Total	1304,0	1568,4	688,9	504,1	227,3	322,8	477,2

^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	8.72%		8.40%	5.85%	6.67%
15-35	8.79%		8.88%	8.63%	8.80%
36-60	8.74%		8.77%	8.36%	8.60%
61-90	8.42%		8.47%	8.21%	8.34%
91-180	-		8.26%	8.07%	8.18%
>180	7.88%		8.03%	7.92%	7.98%
Total	8.76%		8.65%	7.45%	8.30%

^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	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	18	197	2934	2994	41	111	5840	5268	30	154	6906	7179
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1606	1560	0	0	2708	2995	0	0	4001	2905
Otros ^c	197	18	585	564	111	41	1015	1284	154	30	565	1369
Total	215	215	5125	5118	152	152	9563	9547	184	184	11472	11453

^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.