

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de abril de 2023
Fecha de Información: 05 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\$3426 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.15%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	886,4	738,4	569,3	830,8	119,6	6,2	49,5
15-35	535,0	971,9	659,6	214,4	91,8	100,0	220,5
36-60	115,0	172,4	20,0	34,0	72,4	1,0	80,0
61-90	58,3	84,4	38,2	50,0	46,2	8,3	0,0
91-180	35,3	60,9	2,7	30,0	58,2	5,3	0,0
>180	93,5	57,1	10,5	60,0	13,6	0,5	33,0
Total	1723,5	2085,1	1300,3	1219,2	401,8	121,2	383,0

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	8.15%		7.03%	5.43%	6.22%
15-35	8.22%		7.52%	8.07%	7.81%
36-60	7.91%		8.03%	8.07%	7.98%
61-90	—		8.07%	7.97%	8.03%
91-180	—		8.03%	7.81%	7.99%
>180	7.73%		7.76%	7.68%	7.74%
Total	8.11%		7.43%	6.40%	7.15%

^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.

¹ A 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.

² El 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	03 – 07 abr.				10 - 14 abr.				17 - 21 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	23	50	914	833	34	195	10821	11566	23	197	5053	6671
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	480	584	0	0	5609	4691	0	0	4216	2142
Otros ^c	50	23	119	91	195	34	1551	1706	197	23	426	868
Total	73	73	1513	1508	229	229	17981	17963	220	220	9695	9681

^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.