

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de marzo de 2023
Fecha de Información: 28 de febrero 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\$3510 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.26%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	936,7	787,8	333,1	604,5	167,8	45,3	286,9
15-35	703,1	1029,9	632,4	252,3	65,0	118,3	332,5
36-60	159,2	79,3	21,5	110,6	20,8	11,6	37,0
61-90	1,7	69,5	0,0	0,0	69,5	1,7	0,0
91-180	85,2	62,3	33,6	70,0	28,7	15,2	0,0
>180	182,2	99,7	52,7	147,5	16,7	4,4	30,3
Total	2068,1	2128,6	1073,4	1184,9	368,5	196,5	686,7

^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	8.04%		10.90%	7.79%	8.88%
15-35	8.03%		8.11%	7.93%	8.04%
36-60	7.97%		7.82%	5.87%	6.74%
61-90	-		8.06%	7.80%	8.06%
91-180	-		8.02%	7.95%	7.98%
>180	7.85%		8.02%	7.83%	7.91%
Total	8.02%		8.96%	7.63%	8.26%

^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	27 feb. - 03 mar.				06 - 10 mar.				13 - 17 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	33	115	6848	6643	36	155	8080	7950	48	199	7750	9739
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3431	3174	0	0	3955	3043	0	10	5936	2983
Otros ^c	115	33	1268	1718	155	36	1102	1909	199	38	618	1556
Total	148	148	11547	11535	191	191	13137	12902	247	247	14304	14278

^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.