

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de marzo de 2023
Fecha de Información: 01 de marzo 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\$3624 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.76%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	997,4	899,5	388,8	564,4	161,8	83,9	349,0
15-35	746,3	920,6	686,1	543,7	50,5	18,7	183,9
36-60	110,1	132,7	84,6	64,0	13,1	11,1	35,0
61-90	5,2	12,7	0,0	0,0	12,7	5,2	0,0
91-180	132,8	156,9	81,1	0,0	15,8	72,8	60,0
>180	123,6	14,3	10,0	40,0	4,3	83,6	0,0
Total	2115,4	2136,8	1250,6	1212,2	258,2	275,3	628,0

^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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	7.98%		7.62%	7.13%	7.56%
15-35	7.91%		7.94%	7.85%	7.91%
36-60	7.95%		8.06%	7.87%	7.91%
61-90	-		8.21%	7.34%	7.96%
91-180	7.96%		8.00%	7.81%	7.92%
>180	-		8.21%	7.80%	7.82%
Total	7.96%		7.84%	7.54%	7.76%

^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	22	73	5080	5083	37	155	8682	8548	48	199	7924	9860
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2769	2534	0	0	4216	3339	0	10	5959	3028
Otros ^c	73	22	676	896	155	37	1177	1954	199	38	620	1589
Total	95	95	8525	8513	192	192	14075	13841	247	247	14503	14477

^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.