

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de marzo de 2023
Fecha de Información: 02 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\$3809 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.58%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	1272,8	556,8	227,4	946,5	15,0	11,8	314,5
15-35	780,3	1506,6	971,5	262,2	45,2	28,3	489,8
36-60	8,1	57,6	50,0	0,0	7,6	8,1	0,0
61-90	15,0	51,7	27,5	0,0	9,2	0,0	15,0
91-180	120,2	185,7	100,0	50,0	35,7	20,2	50,0
>180	58,6	89,4	62,0	12,0	2,4	21,6	25,0
Total	2255,1	2447,9	1438,4	1270,7	115,2	90,0	894,3

^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	7.93%		7.72%	6.68%	7.13%
15-35	7.96%		7.77%	7.92%	7.85%
36-60	-		7.96%	7.91%	7.95%
61-90	7.89%		8.31%	6.76%	8.05%
91-180	7.95%		8.01%	7.92%	7.96%
>180	7.89%		7.88%	7.78%	7.85%
Total	7.95%		7.80%	7.02%	7.58%

^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	10	56	3688	3478	38	155	9389	9076	48	200	8219	10025
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	2013	2121	0	0	4427	3729	0	10	5983	3160
Otros ^c	56	10	393	481	155	38	1181	1958	200	38	626	1615
Total	66	66	6094	6080	193	193	14997	14763	248	248	14828	14800

^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.