

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de marzo de 2023
Fecha de Información: 03 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\$2781 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.76%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	877,8	784,9	128,7	386,5	183,0	18,2	473,2
15-35	438,9	599,8	343,7	208,2	36,1	10,7	220,0
36-60	65,9	65,0	50,0	65,6	15,0	0,3	0,0
61-90	51,9	140,2	75,3	0,0	13,2	0,2	51,8
91-180	133,9	106,2	3,6	30,0	47,5	48,9	55,0
>180	231,6	196,6	68,0	40,0	16,6	79,6	112,0
Total	1800,1	1892,7	669,3	730,3	311,4	157,8	912,0

^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	7.95%		7.25%	7.08%	7.53%
15-35	7.99%		8.08%	7.70%	7.98%
36-60	-		8.00%	7.88%	8.00%
61-90	7.92%		7.95%	7.56%	7.94%
91-180	7.90%		8.01%	7.71%	7.85%
>180	7.88%		7.98%	7.88%	7.89%
Total	7.95%		7.81%	7.41%	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. 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	8	32	1852	1825	43	160	10000	9717	53	201	8717	10356
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1109	1250	0	0	4720	4120	0	10	6195	3582
Otros ^c	32	8	267	153	160	43	1311	1960	201	43	675	1621
Total	40	40	3228	3228	203	203	16031	15797	254	254	15587	15559

^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.