

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de marzo de 2023
Fecha de Información: 06 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\$4858 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.15%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	1335,3	1466,3	868,9	1034,7	334,0	37,3	263,3
15-35	694,0	718,1	311,1	329,1	65,9	23,8	341,1
36-60	359,6	149,4	29,2	184,0	40,6	95,9	79,7
61-90	0,5	35,1	0,0	0,0	35,1	0,5	0,0
91-180	266,4	289,7	140,0	25,0	74,7	166,4	75,0
>180	161,4	191,1	112,3	90,0	28,8	21,4	50,0
Total	2817,2	2849,6	1461,4	1662,8	579,0	345,2	809,2

^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%		6.60%	5.52%	6.38%
15-35	8.00%		8.05%	7.91%	8.00%
36-60	7.92%		8.21%	7.81%	7.91%
61-90	-		8.13%	7.82%	8.13%
91-180	7.87%		7.86%	7.55%	7.74%
>180	7.70%		7.83%	7.72%	7.76%
Total	7.97%		7.23%	6.57%	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.

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	06 – 10 mar.				13 - 17 mar.				20 - 24 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	44	161	10686	10119	55	206	8938	11015	28	149	5050	4392
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4836	4557	0	10	6548	3704	0	0	1928	1618
Otros ^c	161	44	1407	2019	206	45	908	1647	149	28	566	1525
Total	205	205	16929	16695	261	261	16394	16366	177	177	7544	7535

^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.