

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de marzo de 2023
Fecha de Información: 07 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\$5677 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.78%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	1362,0	1489,8	576,5	957,3	522,6	13,9	390,8
15-35	995,3	964,1	399,0	456,8	63,2	36,7	501,8
36-60	252,5	99,7	15,0	62,0	24,7	130,5	60,0
61-90	288,5	22,1	2,2	0,0	19,9	288,5	0,0
91-180	342,1	159,1	89,7	180,0	24,0	116,8	45,3
>180	207,1	653,6	470,0	44,1	22,6	2,0	161,0
Total	3447,5	3388,4	1552,5	1700,2	677,0	588,4	1158,9

^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%		7.61%	8.01%	7.77%
15-35	7.83%		7.89%	7.63%	7.80%
36-60	7.90%		7.93%	7.78%	7.82%
61-90	-		8.15%	7.80%	7.82%
91-180	7.84%		7.92%	7.76%	7.80%
>180	7.61%		7.87%	7.54%	7.62%
Total	7.84%		7.72%	7.80%	7.78%

^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	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	41	130	9719	9430	61	208	9941	11963	28	149	5273	4556
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4322	3838	0	10	6964	4553	0	0	1978	1665
Otros ^c	130	41	1331	1873	208	51	1290	1651	149	28	572	1593
Total	171	171	15372	15141	269	269	18195	18167	177	177	7823	7814

^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.