

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de marzo de 2023
Fecha de Información: 08 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\$3276 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.39%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	795,2	721,5	387,9	431,0	42,8	73,4	290,8
15-35	1179,8	826,2	296,1	706,1	66,8	10,3	463,3
36-60	18,8	35,9	1,2	0,0	20,7	4,8	14,0
61-90	1,1	15,5	0,0	0,0	15,5	1,1	0,0
91-180	120,9	314,2	240,0	40,3	13,9	20,3	60,4
>180	20,0	65,6	30,0	0,0	25,6	10,0	10,0
Total	2135,7	1979,0	955,2	1177,4	185,3	119,8	838,5

^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	8.31%		6.36%	6.24%	6.84%
15-35	8.04%		7.89%	7.53%	7.85%
36-60	7.93%		7.48%	7.72%	7.67%
61-90	-		7.63%	7.84%	7.65%
91-180	7.83%		7.08%	7.79%	7.56%
>180	7.64%		7.84%	7.66%	7.76%
Total	8.11%		7.16%	6.90%	7.39%

^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	34	107	7331	7014	64	211	10432	12350	28	150	5352	4697
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3377	2972	0	10	7181	4818	0	0	1968	1665
Otros ^c	107	34	540	1032	211	54	1294	1710	150	28	653	1601
Total	141	141	11248	11018	275	275	18907	18878	178	178	7973	7963

^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.