

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de marzo de 2023
Fecha de Información: 09 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\$4413 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.78%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	698,0	827,8	472,4	478,3	0,0	14,2	205,5
15-35	1834,5	1774,7	421,4	475,0	30,8	37,1	1322,5
36-60	3,4	30,4	0,0	0,0	30,4	3,4	0,0
61-90	215,5	111,7	72,7	62,8	6,9	120,6	32,2
91-180	215,5	268,9	190,3	175,2	38,5	0,3	40,0
>180	18,4	23,9	1,6	0,0	12,3	8,4	10,0
Total	2985,3	3037,4	1158,5	1191,2	118,8	183,9	1610,2

^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	7.93%		7.36%	7.49%	7.54%
15-35	7.91%		7.87%	7.82%	7.88%
36-60	-		7.88%	7.50%	7.84%
61-90	7.74%		7.84%	7.74%	7.76%
91-180	7.78%		7.84%	7.79%	7.83%
>180	7.66%		7.76%	7.33%	7.61%
Total	7.90%		7.70%	7.66%	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	14	76	3630	4069	68	211	10975	12973	28	150	5456	4891
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2140	1410	0	10	7520	5201	0	0	2057	1665
Otros ^c	75	14	356	644	211	58	1422	1713	150	28	670	1618
Total	89	90	6126	6123	279	279	19917	19887	178	178	8183	8174

^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.