

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2023
Fecha de Información: 10 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\$4084 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.75%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	1249,3	808,6	334,4	852,9	174,9	97,1	299,3
15-35	972,4	1422,6	645,7	265,8	84,7	14,4	692,2
36-60	39,0	49,4	0,0	1,5	49,4	37,5	0,0
61-90	31,7	28,0	0,0	0,0	18,0	21,7	10,0
91-180	225,7	355,6	0,0	0,0	132,6	2,7	223,0
>180	27,9	98,0	80,0	20,0	18,0	7,9	0,0
Total	2546,0	2762,3	1060,1	1140,2	477,6	181,2	1224,5

^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	7.94%		7.83%	7.16%	7.51%
15-35	7.90%		7.92%	7.93%	7.91%
36-60	-		7.74%	7.86%	7.79%
61-90	8.08%		8.03%	7.71%	7.90%
91-180	7.87%		7.79%	7.77%	7.84%
>180	-		7.63%	7.54%	7.61%
Total	7.90%		7.86%	7.40%	7.75%

^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	12	35	1815	2000	71	213	11923	13565	29	154	5586	5019
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1125	796	0	10	7796	5904	0	0	2096	1709
Otros ^c	34	12	186	327	213	61	1581	1802	154	29	679	1623
Total	46	47	3126	3123	284	284	21300	21271	183	183	8361	8351

^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.