

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2023
Fecha de Información: 13 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\$3533 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.92%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	319,8	478,7	256,0	182,4	0,0	37,4	100
15-35	977,0	1054,2	595,2	522,6	27,1	22,4	432
36-60	162,8	137,1	44,0	79,3	13,1	3,5	80
61-90	94,6	3,3	0,0	0,0	3,3	94,6	0
91-180	292,1	337,4	113,9	153,0	84,5	0,1	139
>180	111,1	396,0	315,0	30,0	1,0	1,1	80
Total	1957,4	2406,6	1324,1	967,2	128,9	159,2	831

^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	8.08%		7.98%	7.69%	7.94%
15-35	7.96%		8.01%	7.85%	7.95%
36-60	7.93%		8.06%	7.75%	7.91%
61-90	-		8.10%	7.83%	7.84%
91-180	7.84%		7.90%	7.92%	7.88%
>180	7.75%		7.79%	7.77%	7.78%
Total	7.93%		7.96%	7.82%	7.92%

^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	13 – 17 mar.				20 - 24 mar.				27 - 31 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	72	211	12326	13953	32	158	5727	5188	35	189	5208	6113
Intragruppo y off-shore ^b	0	10	8004	6115	0	0	2190	1779	0	0	3922	2132
Otros ^c	211	62	1679	1912	158	32	692	1632	189	35	700	1531
Total	283	283	22009	21980	190	190	8609	8599	224	224	9830	9776

^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.