

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de marzo de 2023
Fecha de Información: 21 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\$3088 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.18%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	599,4	787,3	276,4	280,0	218,2	26,8	292,6
15-35	648,8	836,0	375,2	146,0	17,1	0,0	502,8
36-60	288,5	26,4	2,5	183,0	8,9	90,5	15,0
61-90	134,6	78,1	55,5	0,6	22,6	134,0	0,0
91-180	60,4	99,2	21,0	0,0	62,2	44,4	16,0
>180	242,6	288,5	97,6	60,8	15,3	6,2	175,6
Total	1974,4	2115,5	828,3	670,4	344,4	301,9	1002,0

^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	8.39%		8.21%	8.19%	8.27%
15-35	8.32%		8.46%	8.25%	8.35%
36-60	8.08%		8.30%	8.11%	8.12%
61-90	-		8.00%	8.04%	8.03%
91-180	7.87%		8.09%	7.82%	7.98%
>180	7.65%		7.83%	7.49%	7.69%
Total	8.21%		8.21%	8.11%	8.18%

^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	20 – 24 mar.				27 - 31 mar.				03 - 07 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	39	165	7188	7105	46	203	5748	6921	23	81	5185	5758
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2674	2405	0	0	4198	2330	0	0	3002	2294
Otros ^c	165	39	1611	1949	203	46	948	1588	81	23	244	369
Total	204	204	11473	11459	249	249	10894	10839	104	104	8431	8421

^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.