

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2023
Fecha de Información: 22 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\$2809 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.09%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	483,6	454,1	309,7	401,7	76,7	14,2	67,7
15-35	590,9	692,1	413,7	307,8	26,0	30,7	252,4
36-60	248,8	127,8	0,0	92,5	32,8	61,3	95,0
61-90	86,0	18,8	2,3	67,0	16,5	19,0	0,0
91-180	95,8	64,9	5,9	20,0	37,3	54,1	21,7
>180	167,7	230,1	187,9	132,5	27,2	20,2	15,0
Total	1672,7	1587,8	919,6	1021,5	216,4	199,5	451,8

^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	8.12%		8.24%	8.18%	8.20%
15-35	8.21%		8.31%	8.15%	8.23%
36-60	8.01%		8.22%	8.04%	8.05%
61-90	-		7.87%	7.82%	7.85%
91-180	7.84%		7.99%	7.76%	7.84%
>180	7.74%		7.68%	7.46%	7.61%
Total	8.12%		8.13%	8.03%	8.09%

^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	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	35	127	5759	5806	47	204	6001	7278	23	83	5212	5800
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2101	1862	0	0	4424	2511	0	0	3037	2314
Otros ^c	127	35	1292	1472	204	47	1017	1597	83	23	245	371
Total	162	162	9152	9140	251	251	11442	11386	106	106	8494	8485

^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.