

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2023
Fecha de Información: 23 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\$2518 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.80%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	247,0	378,5	215,5	121,9	91,7	53,8	71,3
15-35	1109,3	718,8	235,4	620,8	31,9	37,0	451,5
36-60	61,1	32,4	22,2	0,0	10,2	61,1	0,0
61-90	113,8	86,7	1,7	3,0	15,0	40,8	70,0
91-180	16,8	47,2	3,9	0,0	28,3	1,8	15,0
>180	77,4	249,7	222,7	62,0	14,0	2,4	13,0
Total	1625,4	1513,3	701,4	807,8	191,1	196,8	620,8

^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	8.10%		7.98%	7.90%	7.99%
15-35	8.08%		7.50%	7.42%	7.72%
36-60	-		8.16%	8.00%	8.03%
61-90	7.99%		8.21%	7.93%	8.00%
91-180	7.89%		7.94%	7.65%	7.91%
>180	7.45%		7.42%	7.40%	7.41%
Total	8.06%		7.76%	7.58%	7.80%

^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	10	79	3673	3838	47	204	6088	7451	23	86	5287	5833
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1774	1346	0	0	4491	2533	0	0	3037	2347
Otros ^c	79	10	392	648	204	47	1102	1641	86	23	243	377
Total	89	89	5839	5832	251	251	11681	11625	109	109	8567	8557

^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.