

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de marzo de 2023
Fecha de Información: 24 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\$2392 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.83%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	363,6	380,4	169,0	210,0	83,4	25,6	128,0
15-35	845,8	892,9	353,8	314,6	39,5	31,5	499,7
36-60	88,3	30,0	0,0	0,0	20,0	78,3	10,0
61-90	53,2	61,9	5,4	19,2	26,5	4,0	30,0
91-180	142,7	98,4	2,5	55,0	43,4	35,2	52,5
>180	89,2	105,3	55,7	45,0	9,6	4,2	40,0
Total	1582,9	1568,9	586,3	643,8	222,4	178,8	760,2

^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	8.15%		7.25%	6.81%	7.32%
15-35	8.12%		8.12%	8.04%	8.10%
36-60	8.07%		8.20%	7.89%	7.97%
61-90	7.98%		8.01%	7.96%	7.99%
91-180	7.82%		7.94%	7.78%	7.85%
>180	7.72%		7.57%	7.60%	7.63%
Total	8.08%		7.72%	7.62%	7.83%

^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	6	38	706	769	49	208	6435	7787	24	87	5338	5887
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	492	346	0	0	4565	2671	0	0	3086	2396
Otros ^c	38	6	103	181	208	49	1176	1663	87	24	248	379
Total	44	44	1301	1296	257	257	12176	12121	111	111	8672	8662

^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.