

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de marzo de 2023
Fecha de Información: 27 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\$4345 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.66%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1147,3	1408,2	139,0	352,1	495,1	21,1	774,1
15-35	1103,8	1082,3	371,4	437,5	63,7	19,1	647,2
36-60	140,3	94,1	0,0	40,0	57,1	63,3	37,0
61-90	370,6	62,9	12,7	0,0	50,2	370,6	0,0
91-180	136,6	141,4	23,3	10,0	93,1	101,6	25,0
>180	74,1	96,9	21,4	40,0	45,5	4,1	30,0
Total	2972,7	2885,7	567,7	879,6	804,7	579,8	1513,3

^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	8.09%		5.63%	7.97%	7.22%
15-35	8.04%		8.09%	8.07%	8.07%
36-60	8.00%		8.25%	7.97%	8.06%
61-90	-		8.18%	7.75%	7.80%
91-180	7.84%		8.04%	7.83%	7.93%
>180	7.73%		7.85%	7.42%	7.73%
Total	8.06%		6.94%	7.91%	7.66%

^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	27 – 31 mar.				03 - 07 abr.				10 - 14 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	50	212	6999	8546	24	88	5901	6325	21	162	8024	8743
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4667	2860	0	0	3108	2538	0	0	4547	2823
Otros ^c	212	50	1555	1760	88	24	257	392	162	21	561	1551
Total	262	262	13221	13166	112	112	9266	9255	183	183	13132	13117

^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.