

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2023
Fecha de Información: 29 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\$3602 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.22%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	547,5	680,7	63,5	390,5	0,0	41,5	115,5
15-35	831,1	902,4	470,5	448,1	0,0	38,3	344,7
36-60	303,2	45,2	0,0	0,0	45,2	303,2	0,0
61-90	42,2	75,8	0,0	40,2	0,0	2,0	0,0
91-180	11,8	282,0	124,7	0,8	147,3	1,0	10,0
>180	248,6	116,7	37,3	80,8	64,4	152,9	15,0
Total	1984,5	2102,9	696,1	960,4	256,9	539,0	485,2

^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	7.99%		6.11%	6.54%	6.49%
15-35	7.76%		7.37%	7.72%	7.60%
36-60	-		7.98%	7.43%	7.51%
61-90	-		8.00%	6.11%	7.57%
91-180	7.75%		7.88%	7.66%	7.87%
>180	7.79%		7.91%	7.46%	7.61%
Total	7.81%		7.01%	7.20%	7.22%

^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	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	44	123	6660	7589	41	98	6281	6681	25	175	8429	9338
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4285	3274	0	0	3139	2839	0	0	4636	3047
Otros ^c	123	44	1408	1439	98	41	503	393	175	25	899	1563
Total	167	167	12353	12302	139	139	9923	9913	200	200	13964	13948

^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.