

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de febrero de 2023
Fecha de Información: 07 de febrero 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\$3692 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.22%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	751,1	1111,8	296,9	305,1	426,0	57,0	389,0
15-35	765,8	993,8	607,4	267,7	23,6	135,3	362,8
36-60	240,5	5,1	0,0	100,0	5,1	140,5	0,0
61-90	344,0	24,8	20,4	71,0	4,4	273,0	0,0
91-180	52,0	60,5	0,0	0,0	10,5	2,0	50,0
>180	53,1	111,4	0,0	30,0	91,4	3,1	20,0
Total	2206,4	2307,5	924,7	773,7	561,0	610,9	821,8

^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	7.91%		5.34%	6.39%	6.40%
15-35	7.88%		7.90%	7.80%	7.86%
36-60	-		8.12%	7.82%	7.83%
61-90	-		8.08%	7.51%	7.52%
91-180	7.87%		8.05%	7.65%	7.89%
>180	7.63%		7.85%	7.55%	7.75%
Total	7.89%		6.62%	7.33%	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	06 – 10 feb.				13 - 17 feb.				20 - 24 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	25	173	6914	7184	43	246	6099	7008	19	259	7130	6453
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	3758	3621	0	0	3884	2646	0	0	3985	3868
Otros ^c	173	25	1044	864	246	43	1361	1670	259	19	617	1391
Total	198	198	11716	11669	289	289	11344	11324	278	278	11732	11712

^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.