

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de febrero de 2023
Fecha de Información: 08 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\$3798 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.17%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	755,7	837,8	328,5	590,3	389,3	45,4	120,0
15-35	794,5	1153,3	825,4	349,4	12,5	129,6	315,4
36-60	357,9	33,0	30,0	77,0	3,0	280,9	0,0
61-90	23,9	170,4	152,0	0,0	8,4	13,9	10,0
91-180	2,0	51,6	0,0	0,0	51,6	2,0	0,0
>180	46,5	51,5	10,0	0,0	6,5	11,5	35,0
Total	1980,6	2297,6	1345,9	1016,7	471,3	483,4	480,4

^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	7.84%		7.15%	5.90%	6.66%
15-35	7.85%		7.42%	7.13%	7.44%
36-60	-		6.72%	7.77%	7.76%
61-90	7.83%		7.80%	7.82%	7.80%
91-180	-		7.96%	7.68%	7.95%
>180	7.70%		8.38%	7.11%	7.66%
Total	7.84%		7.35%	6.70%	7.17%

^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	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	19	151	6644	6388	44	251	6329	7507	20	257	7167	6504
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3221	3496	0	0	4089	2850	0	0	3989	3868
Otros ^c	151	19	861	806	251	44	1639	1680	257	20	639	1404
Total	170	170	10726	10690	295	295	12057	12037	277	277	11795	11776

^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.