

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de febrero de 2023
Fecha de Información: 09 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\$2528 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.60%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	352,7	433,2	104,5	78,5	74,6	20,2	254,1
15-35	1052,6	815,5	381,0	478,7	15,5	154,9	419,0
36-60	29,3	74,0	40,0	0,0	34,0	29,3	0,0
61-90	105,5	55,6	1,6	65,0	14,0	0,5	40,0
91-180	65,3	143,3	60,9	10,0	27,4	0,3	55,0
>180	15,0	168,5	148,2	0,0	5,2	0,0	15,0
Total	1620,5	1690,1	736,3	632,2	170,7	205,2	783,1

^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	7.96%		7.46%	7.24%	7.67%
15-35	7.92%		6.72%	7.64%	7.48%
36-60	-		7.93%	7.80%	7.89%
61-90	7.85%		8.07%	7.82%	7.88%
91-180	7.91%		7.93%	7.97%	7.93%
>180	7.70%		8.09%	7.68%	7.80%
Total	7.92%		7.19%	7.60%	7.60%

^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	18	93	4953	5030	49	253	6612	7763	20	259	7227	6594
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2635	2736	0	0	4170	2970	0	0	4012	3868
Otros ^c	93	18	582	385	253	49	1663	1692	259	20	648	1405
Total	111	111	8170	8151	302	302	12445	12425	279	279	11887	11867

^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.