

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2023
Fecha de Información: 10 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\$3242 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.79%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	607,9	613,7	212,3	365,3	267,8	108,9	133,7
15-35	652,2	1264,7	786,6	286,4	138,2	25,9	339,8
36-60	132,7	16,8	7,0	0,0	9,8	132,7	0,0
61-90	121,4	35,1	30,0	0,0	5,1	121,4	0,0
91-180	42,6	63,6	50,0	33,3	7,3	3,1	6,3
>180	89,1	147,3	77,0	5,0	5,3	19,1	65,0
Total	1646,0	2141,2	1162,9	690,0	433,5	411,2	544,8

^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	7.93%		8.89%	6.33%	7.68%
15-35	8.00%		7.76%	7.99%	7.86%
36-60	-		7.92%	7.83%	7.84%
61-90	-		7.85%	7.82%	7.82%
91-180	7.68%		8.07%	7.93%	7.94%
>180	7.92%		7.88%	7.32%	7.78%
Total	7.97%		8.17%	7.16%	7.79%

^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	8	60	839	915	51	257	6991	8246	21	259	7432	6828
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	225	348	0	0	4310	3165	0	0	4163	3988
Otros ^c	60	8	357	150	257	51	1922	1793	259	21	650	1410
Total	68	68	1421	1413	308	308	13223	13204	280	280	12245	12226

^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.