

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2023
Fecha de Información: 13 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\$4451 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.46%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	398,9	1011,7	480,3	275,7	429,7	21,4	101,8
15-35	413,7	780,2	648,8	296,4	29,7	15,6	101,7
36-60	944,4	117,1	50,8	585,8	43,1	335,4	23,2
61-90	419,4	110,7	102,5	67,7	3,2	346,7	5,0
91-180	50,2	20,8	12,7	39,7	8,1	10,5	0,0
>180	140,1	282,4	273,5	129,0	1,9	4,1	7,0
Total	2366,8	2322,9	1568,5	1394,3	515,6	733,8	238,7

^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	8.00%		6.11%	8.17%	6.78%
15-35	8.05%		8.09%	7.60%	7.92%
36-60	8.00%		8.04%	7.96%	7.97%
61-90	7.95%		8.00%	7.63%	7.64%
91-180	-		8.03%	7.95%	7.98%
>180	7.93%		8.04%	7.86%	7.92%
Total	8.02%		6.96%	7.83%	7.46%

^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	13 – 17 feb.				20 - 24 feb.				27 feb. - 03 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	51	260	7449	8537	22	259	7589	7501	28	161	4839	5169
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4525	3497	0	0	4362	4092	0	0	3108	1913
Otros ^c	260	51	1927	1846	259	22	1075	1413	161	28	736	1584
Total	311	311	13901	13880	281	281	13026	13006	189	189	8683	8666

^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.