

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2023
Fecha de Información: 14 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\$3664 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.24%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	938,1	745,7	238,5	581,3	175,8	0,0	356,7
15-35	576,9	933,0	690,6	226,2	44,5	152,7	198,0
36-60	333,0	396,4	89,4	0,0	7,1	33,0	300,0
61-90	281,8	281,8	128,1	0,0	3,8	131,8	150,0
91-180	10,1	22,5	0,7	0,0	21,8	10,1	0,0
>180	80,3	83,7	58,0	54,0	10,7	11,3	15,0
Total	2220,1	2463,1	1205,2	861,5	263,5	338,9	1019,7

^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	8.01%	4.11%	6.55%	6.29%
15-35	7.94%	7.85%	7.95%	7.89%
36-60	7.92%	7.98%	7.84%	7.91%
61-90	7.93%	8.29%	7.20%	7.60%
91-180	–	8.11%	7.75%	7.99%
>180	7.88%	7.97%	7.79%	7.91%
Total	7.95%	6.68%	7.09%	7.24%

^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	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	28	228	7080	7971	22	272	7776	7770	28	161	4965	5272
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4309	3352	0	0	4366	4161	0	0	3183	1998
Otros ^c	228	28	1610	1662	272	22	1232	1423	161	28	744	1605
Total	256	256	12999	12985	294	294	13374	13354	189	189	8892	8875

^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.