

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2023
Fecha de Información: 15 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\$3517 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	737,6	302,3	214,2	591,0	12,5	70,8	75,7
15-35	728,2	1291,7	924,3	322,7	26,1	64,2	341,2
36-60	121,9	238,0	126,4	0,0	6,6	16,9	105,0
61-90	124,7	134,4	11,2	0,0	18,2	19,7	105,0
91-180	43,9	55,0	0,0	35,0	54,7	8,7	0,3
>180	170,7	250,4	190,0	100,0	5,4	15,7	55,0
Total	1927,0	2271,8	1466,1	1048,8	123,5	196,1	682,2

^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	7.95%		7.84%	7.47%	7.61%
15-35	7.92%		7.83%	7.86%	7.86%
36-60	7.93%		7.95%	7.65%	7.90%
61-90	7.88%		7.91%	7.79%	7.88%
91-180	7.90%		7.99%	7.80%	7.91%
>180	7.86%		7.80%	7.78%	7.80%
Total	7.92%		7.84%	7.63%	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	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	22	201	5751	6225	26	272	8019	7967	30	161	5215	5369
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3709	3060	0	0	4523	4354	0	0	3244	2169
Otros ^c	201	22	668	827	272	26	1234	1436	161	30	751	1656
Total	223	223	10128	10112	298	298	13776	13757	191	191	9210	9194

^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.