

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2023
Fecha de Información: 16 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\$3199 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.38%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	583,7	384,9	266,1	414,8	51,8	101,9	67,0
15-35	747,9	957,2	652,6	400,4	27,8	70,8	276,8
36-60	59,8	156,7	148,5	0,0	3,7	55,3	4,5
61-90	62,5	32,1	1,0	24,6	1,1	7,9	30,0
91-180	346,8	287,0	70,3	130,4	16,7	16,4	200,0
>180	119,3	87,5	29,9	35,0	9,6	36,3	48,0
Total	1920,0	1905,5	1168,5	1005,1	110,8	288,6	626,3

^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	7.91%		6.59%	6.29%	6.56%
15-35	8.03%		7.69%	7.46%	7.72%
36-60	7.80%		8.00%	7.82%	7.83%
61-90	7.84%		8.14%	7.69%	7.81%
91-180	7.93%		7.93%	7.87%	7.91%
>180	7.99%		7.88%	7.02%	7.56%
Total	7.97%		7.32%	7.03%	7.38%

^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	14	146	4195	4439	27	275	8073	8162	34	161	5521	5493
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2658	2381	0	0	4709	4359	0	0	3260	2323
Otros ^c	146	14	353	379	275	27	1237	1480	161	34	792	1740
Total	160	160	7206	7199	302	302	14019	14001	195	195	9573	9556

^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.