

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2023
Fecha de Información: 17 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\$2729 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.45%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	462,7	563,6	146,0	70,0	40,5	15,6	377,1
15-35	987,7	1065,5	489,1	350,3	22,3	83,4	554,1
36-60	26,0	63,9	60,0	0,0	3,9	26,0	0,0
61-90	205,4	75,1	40,0	173,4	10,1	7,0	25,0
91-180	88,3	83,2	0,0	3,6	23,2	24,8	60,0
>180	57,1	105,0	60,1	18,3	7,0	0,8	38,0
Total	1827,2	1956,2	795,1	615,5	106,8	157,5	1054,2

^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	8.12%		10.15%	21.16%	10.08%
15-35	8.04%		7.86%	7.70%	7.89%
36-60	-		6.54%	7.80%	6.90%
61-90	7.87%		7.83%	7.89%	7.88%
91-180	7.92%		8.02%	7.93%	7.95%
>180	7.94%		7.97%	7.90%	7.95%
Total	8.05%		8.38%	9.20%	8.45%

^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	7	87	678	732	28	284	8283	8399	35	161	5758	5814
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	432	349	0	0	4760	4394	0	0	3355	2343
Otros ^c	87	7	91	121	284	28	1255	1487	161	35	806	1746
Total	94	94	1201	1202	312	312	14298	14280	196	196	9919	9903

^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.