

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de febrero de 2023
Fecha de Información: 22 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\$3042 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.73%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	599,5	517,0	264,4	516,1	193,7	24,5	58,9
15-35	685,3	779,8	499,2	418,2	21,1	7,6	259,5
36-60	303,7	78,6	0,0	100,0	14,2	139,3	64,4
61-90	51,1	55,9	12,6	0,0	43,4	51,1	0,0
91-180	120,9	232,6	95,0	6,0	27,6	4,9	110,0
>180	61,6	74,0	35,8	20,0	13,2	16,6	25,0
Total	1822,1	1737,9	907,0	1060,3	313,1	244,0	517,8

^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	7.88%		7.90%	7.04%	7.45%
15-35	8.01%		7.61%	7.90%	7.80%
36-60	7.91%		7.91%	7.87%	7.89%
61-90	-		7.93%	7.90%	7.91%
91-180	7.92%		7.99%	9.45%	8.02%
>180	7.89%		8.13%	7.88%	7.93%
Total	7.96%		7.79%	7.54%	7.73%

^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	20 – 24 feb.				27 feb. - 03 mar.				06 - 10 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	24	242	7286	7157	38	167	6306	6585	8	145	6880	6546
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4197	3982	0	0	3622	2726	0	0	3743	2564
Otros ^c	242	24	776	1091	167	38	1168	1768	145	8	579	1857
Total	266	266	12259	12230	205	205	11096	11079	153	153	11202	10967

^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.