

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de enero de 2023
Fecha de Información: 10 de enero 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\$3626 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.74%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	929,7	989,8	712,2	755,8	0,0	29,8	144,0
15-35	970,0	656,5	378,6	669,4	84,5	107,1	193,5
36-60	41,3	71,9	33,4	39,0	38,5	2,3	0,0
61-90	11,0	130,9	94,6	3,5	31,4	2,5	5,0
91-180	0,1	26,6	0,2	0,0	26,4	0,1	0,0
>180	0,1	140,4	133,3	0,0	7,0	0,1	0,0
Total	1952,1	2016,1	1352,3	1467,7	187,7	141,9	342,5

^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	6.18%	6.77%	5.86%	6.26%
15-35	6.77%	6.83%	6.79%	6.80%
36-60	–	7.64%	7.21%	7.43%
61-90	7.84%	7.87%	7.64%	7.83%
91-180	–	8.12%	7.80%	8.12%
>180	–	8.42%	8.20%	8.42%
Total	6.53%	7.04%	6.49%	6.74%

^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	09 – 13 ene.				16 - 20 ene.				23 - 27 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	34	168	6791	6537	22	172	5858	5818	13	249	5805	5619
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	4408	4716	0	0	3212	2629	0	0	4160	3048
Otros ^c	168	34	485	373	172	22	1556	2164	249	13	712	1988
Total	202	202	11684	11626	194	194	10626	10611	262	262	10677	10655

^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.