

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de enero de 2023
Fecha de Información: 11 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\$3783 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.11%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	488,7	771,8	554,0	377,3	146,3	39,8	71,5
15-35	1242,5	806,8	408,0	752,6	99,2	190,3	299,6
36-60	144,2	116,2	3,0	92,5	68,2	6,7	45,0
61-90	96,9	177,3	17,1	8,4	73,1	1,5	87,0
91-180	3,5	105,6	49,0	0,0	54,1	1,0	2,5
>180	165,2	224,7	120,0	109,5	49,7	0,7	55,0
Total	2140,9	2202,4	1151,1	1340,3	490,7	239,9	560,6

^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	6.92%		6.99%	6.73%	6.84%
15-35	6.74%		6.96%	6.96%	6.91%
36-60	7.65%		7.54%	7.57%	7.58%
61-90	7.76%		7.85%	7.79%	7.80%
91-180	8.07%		8.15%	7.91%	8.15%
>180	8.12%		8.40%	8.41%	8.28%
Total	7.14%		7.25%	6.94%	7.11%

^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	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	30	144	6384	6099	22	183	5988	6120	13	256	5909	5764
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4308	4466	0	0	3318	2662	0	0	4240	3096
Otros ^c	144	30	387	455	183	22	1673	2180	256	13	725	1993
Total	174	174	11079	11020	205	205	10979	10962	269	269	10874	10853

^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.