

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 23 de enero de 2023
Fecha de Información: 19 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\$4977 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.43%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	661,2	1593,8	668,3	274,5	589,5	50,7	336
15-35	1488,7	605,0	206,3	993,0	80,7	177,7	318
36-60	12,0	109,2	93,0	2,9	16,2	9,1	0
61-90	390,1	19,4	0,0	25,0	19,4	365,1	0
91-180	133,6	353,7	282,7	118,5	55,9	0,1	15
>180	147,4	161,3	100,0	115,0	31,3	2,4	30
Total	2833,1	2842,4	1350,4	1528,9	793,0	605,2	699

^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	7.63%		6.79%	7.33%	7.06%
15-35	7.60%		7.70%	7.58%	7.61%
36-60	-		8.06%	5.86%	7.14%
61-90	-		8.07%	7.68%	7.70%
91-180	7.91%		8.03%	8.13%	8.03%
>180	8.13%		8.26%	8.14%	8.20%
Total	7.64%		7.20%	7.56%	7.43%

^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	16 – 20 ene.				23 - 27 ene.				30 ene. - 03 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	9	98	3733	3768	19	280	7125	8341	22	145	5254	4168
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2254	1841	0	0	5342	3620	0	0	2036	2463
Otros ^c	98	9	597	974	280	19	1645	2130	145	22	771	1415
Total	107	107	6584	6583	299	299	14112	14091	167	167	8061	8046

^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.