

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 24 de enero de 2023
Fecha de Información: 20 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\$3309 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.53%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	522,2	735,5	537,4	401,0	99,6	22,7	98,5
15-35	1116,9	652,9	247,9	781,7	81,6	11,9	323,3
36-60	170,1	71,6	2,4	168,8	68,6	0,8	0,5
61-90	108,3	131,9	2,9	45,0	79,0	13,3	50,0
91-180	45,8	126,6	3,9	44,3	122,7	1,5	0,0
>180	15,0	89,7	45,0	10,0	39,7	0,0	5,0
Total	1978,3	1808,2	839,5	1450,8	491,3	50,2	477,3

^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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	7.67%		7.20%	6.48%	7.06%
15-35	7.59%		7.72%	7.45%	7.55%
36-60	7.90%		8.01%	7.60%	7.73%
61-90	7.97%		8.18%	7.86%	8.04%
91-180	-		8.26%	8.10%	8.24%
>180	8.33%		8.29%	8.33%	8.30%
Total	7.65%		7.68%	7.33%	7.53%

^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 intragruppo.

“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	3	55	550	598	21	293	7468	8815	23	160	5470	4433
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	402	126	0	0	5682	3839	0	0	2236	2645
Otros ^c	55	3	90	319	293	21	1663	2138	160	23	824	1437
Total	58	58	1042	1043	314	314	14813	14792	183	183	8530	8515

^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.