

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2023
Fecha de Información: 23 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\$2125 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.56%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	454,1	312,1	118,3	233,7	38,3	64,9	155,5
15-35	808,1	640,9	267,0	468,8	76,5	0,0	339,3
36-60	20,9	45,0	0,0	12,4	45,0	8,5	0,0
61-90	2,7	57,7	25,5	0,0	31,7	2,2	0,5
91-180	94,4	173,4	4,3	60,0	147,1	0,0	34,4
>180	2,6	44,1	0,0	0,0	43,1	1,6	1,0
Total	1382,8	1273,1	415,1	774,8	381,7	77,2	530,7

^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	7.55%		7.45%	7.41%	7.48%
15-35	7.59%		7.30%	7.17%	7.33%
36-60	-		8.13%	7.72%	8.04%
61-90	8.02%		8.24%	7.85%	8.21%
91-180	8.28%		8.33%	8.22%	8.29%
>180	8.39%		8.46%	8.19%	8.45%
Total	7.62%		7.74%	7.35%	7.56%

^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	23 – 27 ene.				30 ene. - 03 feb.				06 - 10 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	22	299	7875	9030	24	161	5580	4484	9	174	5644	4211
Intragruppo y off-shore ^b	1	0	5750	4066	0	0	2259	2700	0	0	2169	2938
Otros ^c	298	22	1685	2192	161	24	847	1487	174	9	368	984
Total	321	321	15310	15288	185	185	8686	8671	183	183	8181	8133

^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.