

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de enero de 2023
Fecha de Información: 24 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\$4081 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.41%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	504,2	1121,0	256,0	415,8	787,4	10,9	77,5
15-35	784,9	844,3	499,8	314,3	50,5	176,5	294,0
36-60	336,2	143,0	13,6	27,8	49,4	228,4	80,0
61-90	143,6	164,4	25,1	20,0	29,3	13,6	110,0
91-180	411,9	71,8	4,2	0,0	47,6	391,9	20,0
>180	124,0	23,5	0,0	113,9	13,5	0,2	10,0
Total	2304,8	2368,0	798,8	891,8	977,7	821,5	591,5

^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	7.61%		6.39%	7.46%	6.65%
15-35	7.65%		7.71%	7.61%	7.66%
36-60	8.00%		8.02%	7.96%	7.98%
61-90	7.97%		7.97%	7.93%	7.96%
91-180	8.07%		8.22%	7.76%	7.82%
>180	8.18%		8.54%	8.18%	8.22%
Total	7.77%		6.93%	7.75%	7.41%

^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	286	7274	8124	25	167	5712	5196	9	178	5714	4480
Intragruppo y off-shore ^b	1	0	5031	3903	0	0	2270	2769	0	0	2399	2960
Otros ^c	285	22	1633	1896	167	25	1491	1493	178	9	374	1001
Total	308	308	13938	13923	192	192	9473	9458	187	187	8487	8441

^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.