

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de enero de 2023
Fecha de Información: 25 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\$4827 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.61%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1014,6	1124,3	386,3	575,9	361,5	62,2	376,5
15-35	1349,3	1307,4	932,0	632,3	25,9	367,5	349,5
36-60	149,8	83,2	56,9	125,0	16,0	14,5	10,3
61-90	150,0	77,1	0,0	95,0	32,1	10,0	45,0
91-180	32,6	98,0	13,2	5,8	63,6	5,6	21,2
>180	119,3	184,0	114,2	55,0	9,7	4,3	60,0
Total	2815,5	2874,1	1502,7	1489,0	508,9	464,0	862,5

^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	7.62%		7.54%	7.09%	7.46%
15-35	7.64%		7.65%	7.53%	7.59%
36-60	8.00%		8.04%	7.91%	7.96%
61-90	7.95%		8.13%	7.89%	7.99%
91-180	8.05%		8.23%	7.94%	8.17%
>180	8.04%		8.36%	8.06%	8.08%
Total	7.69%		7.68%	7.48%	7.61%

^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	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	17	254	5601	6210	26	176	6017	5832	9	182	5927	5017
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	4192	3410	0	0	2500	2848	0	0	2757	2998
Otros ^c	253	17	1081	1238	176	26	1718	1539	182	9	384	1006
Total	270	271	10874	10858	202	202	10235	10219	191	191	9068	9021

^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.