

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2023
Fecha de Información: 27 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\$2556 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.43%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	180,4	785,9	534,9	89,5	205,5	45,4	45,5
15-35	605,1	695,9	409,6	300,1	51,6	70,2	234,7
36-60	206,8	18,4	6,0	2,7	12,3	204,1	0,0
61-90	70,7	61,2	20,7	50,0	40,5	20,7	0,0
91-180	81,7	76,3	0,0	21,0	36,3	20,8	40,0
>180	55,9	37,7	20,6	51,9	17,0	4,0	0,0
Total	1200,6	1675,3	992,0	515,2	363,2	365,2	320,2

^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	7.78%		7.36%	4.02%	6.79%
15-35	7.65%		7.74%	7.27%	7.63%
36-60	-		8.16%	7.77%	7.79%
61-90	-		8.32%	7.03%	7.60%
91-180	7.86%		8.22%	7.22%	7.75%
>180	-		8.09%	7.94%	7.98%
Total	7.70%		7.64%	6.97%	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	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	8	69	2469	2540	42	190	6407	7137	22	201	6064	5168
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1732	1743	0	0	3313	3023	0	0	2850	3064
Otros ^c	68	8	414	332	190	42	2064	1608	201	22	402	1037
Total	76	77	4615	4615	232	232	11784	11768	223	223	9316	9269

^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.