

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de febrero de 2023

Fecha de Información: 30 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\$2670 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.31%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	588,4	361,5	112,3	249,6	126,7	216,4	122,4
15-35	441,2	762,7	371,6	204,0	277,0	123,1	114,1
36-60	178,2	52,1	12,0	47,8	30,1	120,5	10,0
61-90	49,6	42,8	28,0	40,0	9,8	4,6	5,0
91-180	45,2	40,2	17,6	0,0	17,6	40,2	5,0
>180	202,3	182,3	150,0	180,0	12,3	2,3	20,0
Total	1505,0	1441,5	691,5	721,4	473,5	507,0	276,5

^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	7.27%		7.45%	5.08%	6.27%
15-35	7.82%		7.86%	7.56%	7.76%
36-60	7.72%		7.74%	7.68%	7.69%
61-90	7.77%		8.00%	7.74%	7.81%
91-180	7.79%		8.07%	7.81%	7.90%
>180	7.73%		7.75%	7.79%	7.77%
Total	7.57%		7.74%	6.80%	7.31%

^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	30 ene. - 03 feb.				06 - 10 feb.				13 - 17 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	45	195	7025	7403	23	201	6122	5247	33	242	5417	5518
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3392	3266	0	0	2880	3067	0	0	3185	2233
Otros ^c	195	45	2183	1917	201	23	411	1052	242	33	704	1541
Total	240	240	12600	12586	224	224	9413	9366	275	275	9306	9292

^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.