

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de febrero de 2023

Fecha de Información: 31 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\$2440 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.65%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	330,3	534,4	269,8	233,7	191,6	23,6	73,0
15-35	897,2	561,3	300,3	402,2	60,7	294,7	200,3
36-60	80,0	67,7	34,7	47,7	13,1	12,3	20,0
61-90	22,0	111,1	70,0	0,3	21,1	1,7	20,0
91-180	2,8	62,3	0,0	0,0	62,3	2,8	0,0
>180	52,1	33,6	30,0	50,0	1,6	0,1	2,0
Total	1384,5	1370,3	704,7	733,9	350,4	335,3	315,3

^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	7.70%		7.63%	7.18%	7.50%
15-35	7.71%		7.75%	7.64%	7.68%
36-60	7.81%		7.57%	7.64%	7.69%
61-90	7.83%		7.86%	7.54%	7.85%
91-180	-		7.96%	7.48%	7.94%
>180	7.89%		7.78%	7.82%	7.80%
Total	7.72%		7.72%	7.55%	7.65%

^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	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	40	134	5842	6487	25	203	6270	5617	33	243	5484	5536
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3180	2884	0	0	3018	3158	0	0	3191	2291
Otros ^c	134	40	1656	1304	203	25	593	1059	243	33	715	1551
Total	174	174	10678	10675	228	228	9881	9834	276	276	9390	9378

^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.