

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de febrero de 2023
Fecha de Información: 01 de febrero 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\$3391 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.68%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	943,8	727,0	457,3	819,7	157,7	12,2	111,9
15-35	536,9	1052,7	799,0	137,3	28,1	174,1	225,6
36-60	37,9	16,4	0,0	20,0	6,4	7,9	10,0
61-90	105,8	114,4	20,0	16,0	9,4	4,8	85,0
91-180	11,2	32,4	0,0	0,0	32,4	11,2	0,0
>180	181,7	68,7	55,0	170,0	8,7	6,7	5,0
Total	1817,2	2011,6	1331,4	1162,9	242,7	216,8	437,5

^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	7.75%		7.74%	7.55%	7.71%
15-35	7.70%		7.74%	7.67%	7.70%
36-60	7.88%		7.38%	7.83%	7.78%
61-90	7.88%		7.77%	8.00%	7.88%
91-180	-		8.07%	4.83%	7.24%
>180	7.83%		7.87%	7.35%	7.51%
Total	7.76%		7.77%	7.53%	7.68%

^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	25	104	5067	5169	25	203	6441	6314	34	244	5528	5621
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3002	3040	0	0	3478	3245	0	0	3262	2298
Otros ^c	104	25	861	718	203	25	748	1062	244	34	719	1570
Total	129	129	8930	8927	228	228	10667	10621	278	278	9509	9489

^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.