

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de enero de 2023
Fecha de Información: 28 de diciembre de 2022¹

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\$1527 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.78%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	78,8	187,1	178,0	64,0	9,1	14,8	0,0
15-35	452,0	513,3	332,7	299,0	87,5	59,9	93,1
36-60	84,2	24,9	14,1	75,0	10,7	9,2	0,0
61-90	67,7	47,8	22,0	53,4	25,7	14,4	0,0
91-180	61,9	78,4	0,0	10,0	38,4	0,0	51,9
>180	10,7	75,2	5,6	0,0	59,7	0,7	10,0
Total	755,3	926,6	552,4	501,3	231,1	99,0	155,0

^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	—	6.35%	7.84%	6.85%
15-35	6.57%	6.63%	6.41%	6.52%
36-60	—	6.72%	6.48%	6.51%
61-90	—	7.43%	6.95%	7.29%
91-180	7.33%	7.58%	7.39%	7.44%
>180	7.77%	7.65%	7.58%	7.67%
Total	6.87%	6.84%	6.68%	6.78%

^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.

¹ A 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.

² El 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	26 – 30 dic.				02 - 06 ene.				09 - 13 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	15	109	1756	1991	11	87	3264	3539	23	148	4300	5115
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1218	1071	0	0	2274	2115	0	0	3430	2721
Otros ^c	109	15	311	210	87	11	303	163	148	23	368	215
Total	124	124	3285	3272	98	98	5841	5817	171	171	8098	8051

^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.