

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de enero de 2023

Fecha de Información: 29 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\$3096 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.65%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	1161,3	113,4	44,4	1090,5	7,0	8,8	62
15-35	343,0	517,1	419,2	263,6	87,8	69,4	10
36-60	15,5	10,7	0,0	0,0	10,7	15,5	0
61-90	33,5	87,9	56,0	10,0	11,9	3,5	20
91-180	1,2	829,1	798,4	0,0	30,8	1,2	0
>180	35,7	59,4	15,6	15,6	23,8	0,1	20
Total	1590,2	1617,6	1333,6	1379,7	172,1	98,5	112

^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	6.13%	4.21%	4.98%	5.69%
15-35	6.12%	6.57%	6.38%	6.44%
36-60	—	6.94%	6.67%	6.78%
61-90	7.00%	7.08%	6.77%	7.05%
91-180	—	7.29%	6.95%	7.29%
>180	7.56%	7.71%	7.78%	7.68%
Total	6.54%	6.91%	6.41%	6.65%

^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.

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	5	34	212	242	12	90	3343	3609	27	151	5377	5153
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	66	105	0	0	2300	2149	0	0	3448	3777
Otros ^c	34	5	129	52	90	12	305	165	151	27	368	216
Total	39	39	407	399	102	102	5948	5923	178	178	9193	9146

^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.