

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de enero de 2023
Fecha de Información: 03 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\$1807 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.34%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	262,5	199,5	126,6	200,5	16,9	6,0	56,0
15-35	584,1	537,7	329,0	350,0	12,5	37,9	196,2
36-60	81,9	27,0	0,0	60,0	7,0	1,9	20,0
61-90	60,7	221,9	151,2	0,0	10,8	0,7	60,0
91-180	50,2	27,5	5,0	30,0	2,5	0,2	20,0
>180	18,0	106,3	86,0	0,0	2,3	0,0	18,0
Total	1057,4	1119,9	697,7	640,5	52,0	46,7	370,2

^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	6.49%	6.37%	6.09%	6.31%
15-35	6.20%	5.34%	6.19%	5.99%
36-60	7.05%	6.97%	4.15%	5.03%
61-90	7.20%	7.19%	6.97%	7.19%
91-180	7.55%	7.58%	7.16%	7.55%
>180	7.72%	7.74%	—	7.74%
Total	6.60%	6.56%	5.91%	6.34%

^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	02 – 06 ene.				09 - 13 ene.				16 - 20 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	13	94	3523	3644	27	159	5451	5344	19	166	4962	4856
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2324	2313	0	0	3583	3796	0	0	2983	2163
Otros ^c	94	13	310	175	159	27	373	221	166	19	1078	1987
Total	107	107	6157	6132	186	186	9407	9361	185	185	9023	9006

^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.