

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de enero de 2023
Fecha de Información: 04 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\$1720 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.62%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	323,9	248,9	124,1	172,8	9,4	35,6	115,5
15-35	411,1	622,1	479,3	272,4	29,5	25,4	113,3
36-60	2,9	16,3	10,0	0,0	6,3	2,9	0,0
61-90	24,9	118,3	20,0	0,0	78,3	4,9	20,0
91-180	0,5	6,5	0,0	0,0	6,5	0,5	0,0
>180	92,4	121,3	95,0	70,0	6,3	2,4	20,0
Total	855,8	1133,5	728,4	515,1	136,3	71,8	268,8

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.38%		6.40%	6.42%	6.40%
15-35	6.37%		6.44%	6.29%	6.37%
36-60	—		7.16%	6.42%	7.05%
61-90	7.24%		7.15%	6.98%	7.16%
91-180	—		7.46%	7.37%	7.45%
>180	7.96%		7.80%	7.77%	7.81%
Total	6.55%		6.74%	6.50%	6.62%

^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	8	82	3106	3056	27	159	5571	5536	21	166	5002	4969
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1913	2038	0	0	3686	3806	0	0	3058	2163
Otros ^c	82	8	275	174	159	27	379	247	166	21	1083	1996
Total	90	90	5294	5268	186	186	9636	9589	187	187	9143	9128

^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.