

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de enero de 2023
Fecha de Información: 06 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\$2368 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.92%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	467,5	407,0	11,7	202,9	189,4	58,6	206
15-35	559,3	732,8	397,2	293,8	81,6	11,5	254
36-60	10,7	180,7	148,0	5,5	32,7	5,2	0
61-90	125,4	257,6	120,3	0,0	17,4	5,4	120
91-180	80,1	21,1	0,8	0,0	20,3	80,1	0
>180	45,0	71,1	50,8	35,0	10,3	0,0	10
Total	1288,0	1670,3	728,7	537,1	351,6	160,9	590

^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	6.96%		5.96%	6.69%	6.55%
15-35	6.95%		7.36%	5.25%	6.80%
36-60	—		7.28%	7.08%	7.26%
61-90	7.76%		6.96%	7.44%	7.34%
91-180	—		7.63%	7.06%	7.17%
>180	8.08%		8.20%	8.20%	8.19%
Total	7.14%		7.07%	6.39%	6.92%

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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	5	26	307	368	33	163	6394	5810	22	171	5438	5704
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	242	181	0	0	3871	4485	0	0	3139	2245
Otros ^c	26	5	74	53	163	33	383	294	171	22	1532	2144
Total	31	31	623	602	196	196	10648	10589	193	193	10109	10093

^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.