

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de enero de 2023
Fecha de Información: 13 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\$3581 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.46%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupa y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	876,6	645,1	204,6	428,0	138,5	146,6	302,0
15-35	1346,1	1512,4	514,7	362,5	144,5	130,3	853,3
36-60	29,6	53,8	4,8	2,5	29,0	7,1	20,0
61-90	105,8	42,9	5,0	90,0	27,9	5,8	10,0
91-180	0,2	62,6	0,0	0,0	62,6	0,2	0,0
>180	55,1	55,4	25,0	35,0	10,4	0,1	20,0
Total	2413,5	2372,3	754,2	918,0	412,9	290,3	1205,2

^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	7.26%		6.96%	5.05%	6.11%
15-35	7.27%		5.68%	5.91%	6.46%
36-60	7.25%		7.67%	7.39%	7.48%
61-90	7.65%		7.92%	7.26%	7.43%
91-180	-		8.18%	7.80%	8.18%
>180	8.16%		8.46%	8.28%	8.27%
Total	7.29%		6.31%	5.63%	6.46%

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	09 – 13 ene.				16 - 20 ene.				23 - 27 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	7	58	1189	1226	24	199	6734	6894	14	272	6325	6081
Intragruppo y off-shore ^b	0	0	998	937	0	0	3583	3073	0	0	4329	3245
Otros ^c	58	7	76	96	199	24	1999	2332	272	14	765	2073
Total	65	65	2263	2259	223	223	12316	12299	286	286	11419	11399

^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.