

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2023
Fecha de Información: 16 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\$529 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.73%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	142,1	200,3	98,0	44,5	12,8	8,1	89,5
15-35	167,7	136,9	25,6	85,8	29,8	0,5	81,5
36-60	2,3	10,2	2,2	0,0	8,0	2,3	0,0
61-90	1,3	5,2	0,0	0,0	5,2	1,3	0,0
91-180	1,0	19,0	0,3	0,0	18,7	1,0	0,0
>180	4,4	9,7	0,7	0,0	9,0	4,4	0,0
Total	318,7	381,3	126,8	130,2	83,5	17,5	171,0

^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	4.80%		7.38%	7.31%	5.88%
15-35	7.14%		7.50%	7.02%	7.21%
36-60	—		7.87%	7.15%	7.71%
61-90	—		8.09%	7.70%	8.01%
91-180	—		8.12%	7.76%	8.10%
>180	—		8.32%	8.16%	8.27%
Total	5.92%		7.69%	7.27%	6.73%

^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	16 – 20 ene.				23 - 27 ene.				30 ene. - 03 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	25	202	6830	7074	14	272	6367	6092	21	139	5091	3739
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	3671	3078	0	0	4339	3285	0	0	1869	2434
Otros ^c	202	25	2001	2335	272	14	766	2075	139	21	600	1371
Total	227	227	12502	12487	286	286	11472	11452	160	160	7560	7544

^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.