INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de enero de 2023
Fecha de Información: 05 de enero de 2023[1]

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$3736 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.93%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	739,3	531,8	200,1	536,2	275,2	146,5	56,5
15-35	702,2	1026,3	842,9	478,3	9,5	50,0	173,9
36-60	21,6	7,3	0,0	0,0	7,3	21,6	0,0
61-90	27,8	146,6	115,0	2,0	16,6	10,8	15,0
91-180	256,1	101,2	25,0	2,1	76,2	254,0	0,0
>180	160,6	300,4	260,0	115,3	0,4	5,3	40,0
Total	**1907,5**	**2113,7**	**1443,0**	**1133,9**	**385,2**	**488,2**	**285,4**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	6.91%	6.40%	6.90%	6.62%
15-35	6.79%	6.74%	6.17%	6.50%
36-60	–	8.05%	6.89%	7.18%
61-90	7.49%	7.57%	7.43%	7.52%
91-180	–	7.73%	7.56%	7.61%
>180	8.09%	7.98%	8.01%	8.00%
Total	**7.03%**	**6.98%**	**6.85%**	**6.93%**

[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: ((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

	02 – 06 ene.				09 - 13 ene.				16 - 20 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	8	49	2495	2424	27	159	6110	5651	21	167	5199	5325
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	1536	1592	0	0	3763	4286	0	0	3134	2219
Otros[c]	49	8	131	122	159	27	381	258	167	21	1355	2128
Total	**57**	**57**	**4162**	**4138**	**186**	**186**	**10254**	**10195**	**188**	**188**	**9688**	**9672**

[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.