

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2023
Fecha de Información: 12 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\$3321 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.22%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	535,8	624,5	218,9	333,2	259,6	56,6	146
15-35	1069,0	933,6	537,4	595,0	108,3	186,0	288
36-60	26,0	148,2	13,1	0,0	123,1	14,0	12
61-90	47,1	109,3	9,3	26,0	80,0	1,1	20
91-180	5,4	132,1	38,0	0,0	89,1	0,4	5
>180	91,1	80,2	30,0	80,0	40,2	1,1	10
Total	1774,4	2027,9	846,7	1034,2	700,2	259,2	481

^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	7.17%		6.67%	7.00%	6.88%
15-35	7.43%		7.22%	7.10%	7.21%
36-60	7.20%		7.72%	7.35%	7.64%
61-90	7.77%		7.79%	7.54%	7.74%
91-180	7.70%		8.00%	7.80%	7.98%
>180	7.94%		8.16%	8.09%	8.13%
Total	7.37%		7.26%	7.09%	7.22%

^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	13	93	4246	4053	23	195	6185	6484	14	269	6122	5975
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2668	2902	0	0	3453	2784	0	0	4314	3166
Otros ^c	93	13	275	209	195	23	1872	2226	269	14	759	2034
Total	106	106	7189	7164	218	218	11510	11494	283	283	11195	11175

^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.