

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 05 de diciembre de 2022¹

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\$2669 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.74%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	734,7	697,5	281,1	284,4	69,4	103,4	347,0
15-35	547,9	611,7	364,3	310,8	0,0	15,9	221,2
36-60	127,1	194,5	49,0	49,1	98,0	30,6	47,5
61-90	31,9	46,7	11,0	0,0	5,7	1,9	30,0
91-180	6,3	25,8	0,5	0,0	25,3	6,3	0,0
>180	50,1	255,0	230,0	35,0	10,0	0,1	15,0
Total	1498,1	1831,2	935,9	679,3	208,4	158,1	660,7

^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	6.73%	6.43%	6.08%	6.43%
15-35	6.79%	6.86%	6.71%	6.78%
36-60	6.91%	7.04%	6.86%	6.96%
61-90	7.09%	7.17%	6.95%	7.11%
91-180	—	7.27%	7.10%	7.24%
>180	7.30%	7.29%	7.36%	7.30%
Total	6.79%	6.88%	6.49%	6.74%

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

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	05 – 09 dic.				12 - 16 dic.				19 - 23 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	26	232	5702	6404	56	188	7228	8534	36	365	5549	6389
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2806	2334	1	0	4705	3146	0	0	3766	3001
Otros ^c	192	26	1654	1354	187	56	768	693	365	36	423	340
Total	218	258	10162	10092	244	244	12701	12373	401	401	9738	9730

^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.