

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 06 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\$4516 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.83%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	1120,0	988,2	180,9	549,7	292,8	0,0	570,2
15-35	635,7	910,8	565,3	290,0	0,0	13,7	332,0
36-60	322,8	134,8	8,3	0,0	48,5	244,9	77,9
61-90	207,0	161,3	55,0	50,0	26,6	77,3	79,7
91-180	279,2	288,0	135,0	147,6	24,0	2,6	129,0
>180	384,0	638,1	200,5	19,0	72,6	0,0	365,0
Total	2948,7	3121,2	1145,0	1056,4	464,6	338,4	1553,9

^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	6.45%	6.87%	6.77%	6.68%
15-35	6.80%	6.78%	6.71%	6.77%
36-60	6.81%	6.96%	6.87%	6.87%
61-90	6.97%	7.12%	6.93%	6.99%
91-180	7.09%	6.90%	7.03%	6.99%
>180	7.21%	7.39%	7.30%	7.25%
Total	6.81%	6.90%	6.80%	6.83%

^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	24	187	5767	5949	61	188	7882	9370	36	365	5720	6522
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2710	2498	1	0	4833	3307	0	0	3842	3098
Otros ^c	147	24	1432	1400	187	61	1022	732	365	36	425	358
Total	171	211	9909	9847	249	249	13737	13409	401	401	9987	9978

^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.