

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 07 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\$4062 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.75%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	783,9	509,7	326,6	585,2	6,7	22,3	176,4
15-35	983,0	1194,1	1067,1	874,1	24,6	6,4	102,5
36-60	291,9	257,4	179,8	239,1	42,6	17,8	35,0
61-90	28,9	60,2	35,0	10,0	8,2	1,9	17,0
91-180	41,6	127,4	93,0	1,7	19,4	24,9	15,0
>180	19,5	120,8	110,0	0,0	0,1	8,8	10,7
Total	2148,9	2269,7	1811,5	1710,2	101,6	82,1	356,6

^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	7.18%	6.80%	5.70%	6.50%
15-35	6.69%	6.84%	6.78%	6.78%
36-60	6.83%	6.74%	6.78%	6.76%
61-90	6.95%	6.86%	6.96%	6.90%
91-180	7.16%	6.82%	7.16%	6.91%
>180	7.37%	7.34%	7.28%	7.34%
Total	7.00%	6.89%	6.45%	6.75%

^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	14	115	2554	2815	66	186	8387	9468	37	365	6415	7175
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	1408	1328	1	0	4893	3768	0	0	4442	3740
Otros ^c	115	14	442	235	186	66	1029	744	365	37	428	362
Total	129	129	4404	4378	253	252	14309	13980	402	402	11285	11277

^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.