

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 09 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\$3768 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.59%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	896,8	944,4	531,9	694,8	225,5	15,0	187,0
15-35	500,5	487,0	261,2	313,0	58,6	20,3	167,2
36-60	321,9	132,5	70,0	62,0	23,6	221,0	38,9
61-90	230,8	113,8	5,0	135,0	13,8	0,8	95,0
91-180	128,7	360,7	223,0	1,1	18,0	7,8	119,7
>180	69,9	248,8	185,0	0,0	3,8	9,9	60,0
Total	2148,5	2287,3	1276,1	1205,9	343,4	274,8	667,8

^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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.94%		7.25%	5.14%	6.21%
15-35	6.89%		6.96%	6.14%	6.61%
36-60	6.81%		6.64%	6.86%	6.80%
61-90	7.17%		7.28%	7.26%	7.19%
91-180	6.12%		6.94%	7.01%	6.68%
>180	7.42%		7.29%	7.27%	7.32%
Total	6.85%		7.07%	5.88%	6.59%

^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: ((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

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	6	79	645	736	68	192	8727	10044	38	367	6677	7384
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	169	303	1	0	5179	4027	0	0	4551	3900
Otros ^c	79	6	340	103	191	68	1244	748	367	38	433	369
Total	85	85	1154	1142	260	260	15150	14819	405	405	11661	11653

^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.