

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 12 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\$2248 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.93%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	617,3	288,8	107,7	359,4	40,1	117,0	141,0
15-35	472,0	591,4	426,3	300,3	29,8	36,4	135,3
36-60	106,6	180,5	15,0	12,4	115,5	44,2	50,0
61-90	25,7	64,9	40,0	10,0	9,9	0,7	15,0
91-180	18,2	62,5	20,0	17,7	42,5	0,5	0,0
>180	20,0	161,1	140,0	0,0	1,1	0,0	20,0
Total	1259,8	1349,1	749,0	699,7	238,9	198,7	361,3

^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	7.07%		6.88%	6.37%	6.60%
15-35	7.02%		7.00%	6.98%	7.00%
36-60	7.13%		7.04%	6.63%	6.98%
61-90	7.26%		7.32%	7.22%	7.28%
91-180	—		7.35%	7.26%	7.34%
>180	7.56%		7.60%	—	7.59%
Total	7.10%		7.14%	6.63%	6.93%

^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	12 – 16 dic.				19 - 23 dic.				26 - 30 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	77	195	9331	10193	41	375	6832	7637	16	166	3033	3514
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	5220	4429	0	0	4679	3949	0	0	2242	1923
Otros ^c	194	77	1247	845	375	41	463	380	166	16	373	199
Total	272	272	15798	15467	416	416	11974	11966	182	182	5648	5636

^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.