

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 13 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\$3389 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.55%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	735,6	595,5	311,7	453,2	68,3	66,9	215,5
15-35	642,7	500,9	334,2	498,6	44,7	22,1	122,0
36-60	94,9	246,1	136,2	44,2	99,9	40,7	10,0
61-90	323,8	335,9	108,4	100,4	72,6	68,4	155,0
91-180	45,4	81,1	0,0	0,0	36,1	0,4	45,0
>180	85,2	249,4	244,5	85,0	4,9	0,2	0,0
Total	1927,6	2008,9	1135,0	1181,5	326,4	198,6	547,5

^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	7.05%	6.32%	5.98%	6.33%
15-35	6.71%	7.07%	5.73%	6.40%
36-60	7.00%	6.17%	6.93%	6.31%
61-90	7.24%	7.07%	7.15%	7.17%
91-180	7.26%	7.40%	6.96%	7.32%
>180	—	7.56%	7.71%	7.63%
Total	7.05%	6.67%	6.13%	6.55%

^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	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	55	168	8802	9356	43	378	7042	7928	16	184	3108	3560
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	4906	4214	0	0	4838	4027	0	0	2242	1953
Otros ^c	167	55	1014	821	378	43	521	437	184	16	380	203
Total	223	223	14722	14391	421	421	12401	12392	200	200	5730	5716

^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.