

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 14 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\$1990 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.94%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	365,6	353,6	121,4	183,1	120,2	70,5	112,0
15-35	589,4	517,6	196,2	291,2	40,1	16,9	281,3
36-60	92,5	38,7	15,6	19,5	19,1	69,0	4,0
61-90	143,3	207,9	63,2	25,0	84,6	58,3	60,0
91-180	26,4	47,7	0,0	0,0	47,7	26,4	0,0
>180	36,9	32,5	20,0	0,0	7,5	31,9	5,0
Total	1254,0	1197,9	416,5	518,8	319,2	272,9	462,3

^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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.88%	6.89%	6.64%	6.77%
15-35	6.84%	6.94%	6.80%	6.87%
36-60	6.93%	7.12%	6.92%	6.98%
61-90	7.26%	7.12%	7.07%	7.14%
91-180	—	7.43%	7.15%	7.33%
>180	7.57%	7.58%	7.55%	7.56%
Total	6.91%	7.05%	6.85%	6.94%

^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	44	144	6832	7012	45	381	7302	8254	16	190	3163	3617
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	3746	3489	0	0	4972	4089	0	0	2252	2006
Otros ^c	143	44	757	524	381	45	580	502	190	16	427	205
Total	188	188	11335	11025	426	426	12854	12845	206	206	5842	5828

^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.