

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 15 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\$2783 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.51%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	583,9	537,7	441,2	457,2	18,0	48,2	78,5
15-35	674,4	716,5	464,0	386,2	15,7	51,4	236,7
36-60	46,6	59,0	40,9	2,3	18,1	44,3	0,0
61-90	208,3	101,3	20,0	160,0	36,6	3,6	44,7
91-180	42,3	54,1	28,7	0,0	25,4	42,3	0,0
>180	26,0	113,0	82,4	0,0	10,6	6,0	20,0
Total	1581,5	1581,6	1077,1	1005,7	124,5	195,8	379,9

^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	6.69%	5.45%	6.86%	6.39%
15-35	6.67%	6.36%	6.02%	6.34%
36-60	—	7.00%	6.82%	6.88%
61-90	6.99%	7.09%	6.97%	7.02%
91-180	—	7.40%	7.08%	7.20%
>180	7.49%	7.67%	7.44%	7.53%
Total	6.75%	6.32%	6.55%	6.51%

^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	31	99	3414	3724	60	386	7501	8631	17	191	3276	3624
Intragrupo y off-shore ^b	1	0	2464	2310	0	0	5302	4231	0	0	2253	2107
Otros ^c	98	31	422	262	386	60	588	521	191	17	432	218
Total	130	130	6300	6296	446	446	13391	13383	208	208	5961	5949

^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.