

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 19 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\$2181 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.67%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	252,5	276,6	192,5	167,7	7,5	8,2	76,7
15-35	818,4	722,9	391,5	504,1	37,4	20,3	294,0
36-60	144,9	107,4	51,7	91,0	15,7	13,9	40,0
61-90	36,7	85,2	36,9	10,0	23,4	1,7	25,0
91-180	10,4	120,6	50,0	0,0	60,6	0,4	10,0
>180	10,3	50,3	30,0	0,0	10,3	0,3	10,0
Total	1273,3	1363,2	752,6	772,8	155,0	44,8	455,7

^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	6.85%	6.95%	6.94%	6.92%
15-35	6.89%	6.30%	5.79%	6.31%
36-60	7.20%	7.76%	7.12%	7.28%
61-90	7.29%	7.28%	7.22%	7.28%
91-180	7.47%	7.43%	7.22%	7.43%
>180	7.61%	7.56%	7.42%	7.57%
Total	6.96%	6.76%	6.29%	6.67%

^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	19 – 23 dic.				26 - 30 dic.				02 - 06 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	63	391	7884	8817	17	192	3496	3839	2	78	2856	3310
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	5447	4565	0	0	2399	2267	0	0	2134	1828
Otros ^c	391	63	599	541	192	17	448	224	78	2	268	95
Total	454	454	13930	13923	209	209	6343	6330	80	80	5258	5233

^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.