

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 23 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\$1325 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.01%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	45,2	81,3	56,6	31,2	16,8	6,0	8
15-35	527,5	308,1	259,6	493,2	31,5	17,3	17
36-60	11,9	14,7	0,3	3,2	14,3	8,8	0
61-90	12,6	240,3	203,7	0,0	26,6	2,6	10
91-180	20,2	43,9	0,0	0,0	28,9	5,2	15
>180	49,3	43,7	0,0	20,0	19,7	5,3	24
Total	666,7	731,9	520,2	547,6	137,7	45,1	74

^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	6.54%	6.72%	6.48%	6.60%
15-35	6.63%	6.84%	6.58%	6.69%
36-60	—	7.22%	6.70%	7.02%
61-90	6.97%	7.31%	6.89%	7.19%
91-180	7.56%	7.57%	7.22%	7.53%
>180	7.76%	7.77%	7.48%	7.73%
Total	7.22%	7.15%	6.64%	7.01%

^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	4	35	1201	1206	24	191	3641	4037	3	82	3162	3483
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	801	787	0	0	2575	2383	0	0	2236	2039
Otros ^c	35	4	50	59	191	24	466	248	82	3	286	137
Total	39	39	2052	2052	215	215	6682	6668	85	85	5684	5659

^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.