

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 27 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\$1674 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.57%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragruppo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	118,6	72,8	48,0	75,0	24,8	43,6	0,0
15-35	381,2	492,5	230,7	221,2	140,8	39,0	121,0
36-60	34,0	25,0	1,0	5,0	13,7	18,6	10,3
61-90	17,7	64,7	51,8	8,2	12,9	9,5	0,0
91-180	33,5	236,1	192,5	33,0	43,6	0,5	0,0
>180	244,8	84,5	63,0	244,8	21,5	0,0	0,0
Total	829,7	975,7	587,0	587,1	257,3	111,2	131,3

^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	—	6.46%	5.10%	5.53%
15-35	6.56%	6.67%	6.35%	6.54%
36-60	6.95%	7.04%	6.60%	6.83%
61-90	—	7.21%	6.91%	7.08%
91-180	—	7.51%	7.16%	7.36%
>180	—	7.61%	—	7.61%
Total	6.59%	6.93%	6.10%	6.57%

^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	26 – 30 dic.				02 - 06 ene.				09 - 13 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	24	191	3836	4101	10	86	3212	3515	22	146	4287	4970
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	2603	2430	0	0	2256	2069	0	0	3289	2721
Otros ^c	191	24	499	395	86	10	297	157	146	22	364	202
Total	215	215	6938	6926	96	96	5765	5741	168	168	7940	7893

^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.