INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 02 de diciembre de 2022[1]

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$3001 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.99%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

	Sector Financiero[b]		Intragrupo y Off-shore[c]		Otros Agentes		Intermediarios del
Rango	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	597,3	442,8	41,4	205,0	0,0	16,3	376
15-35	540,7	619,4	265,2	214,2	44,1	16,5	310
36-60	181,0	142,7	6,1	0,0	93,7	138,0	43
61-90	30,1	90,2	36,9	0,0	33,2	10,1	20
91-180	431,4	547,6	90,2	24,0	55,4	5,4	402
>180	369,0	202,8	125,0	326,0	34,8	0,0	43
Total	**2149,5**	**2045,5**	**564,8**	**769,2**	**261,3**	**186,3**	**1194**

[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

	Intermediarios del Mercado Cambiario [a]	Otros Agentes sin intragrupo		
Rango	Compras/Ventas	Compras	Ventas	Total
3-14	6.88%	7.14%	6.71%	6.87%
15-35	6.74%	6.87%	6.72%	6.78%
36-60	6.83%	7.08%	6.76%	6.88%
61-90	7.12%	7.26%	6.87%	7.15%
91-180	7.14%	7.46%	7.11%	7.18%
>180	7.41%	7.68%	7.40%	7.47%
Total	**6.95%**	**7.14%**	**6.93%**	**6.99%**

[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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

	28 nov. - 02 dic.				05 - 09 dic.				12 - 16 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	5	95	710	674	24	191	5227	6020	53	188	7029	8272
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	209	371	0	0	2607	2109	1	0	4622	3087
Otros[c]	95	5	274	143	191	24	1645	1280	187	53	702	667
Total	**100**	**100**	**1193**	**1188**	**215**	**215**	**9479**	**9409**	**241**	**241**	**12353**	**12026**

[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.