INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 16 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$1346 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.77%[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	332,5	127,8	99,0	307,0	24,3	21,0	4,5
15-35	209,1	449,1	357,8	117,0	14,7	15,6	76,5
36-60	13,7	47,8	2,4	0,2	45,4	13,5	0,0
61-90	98,3	113,5	47,7	40,6	15,8	7,7	50,0
91-180	31,6	61,4	0,0	0,0	31,4	1,6	30,0
>180	15,0	20,5	3,0	0,0	4,5	2,0	13,0
Total	**700,2**	**820,1**	**510,0**	**464,8**	**136,1**	**61,4**	**174,0**

[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	6.81%	7.96%	5.86%	6.33%
15-35	6.81%	6.85%	6.50%	6.78%
36-60	–	6.95%	6.67%	6.89%
61-90	7.11%	7.12%	7.13%	7.12%
91-180	7.35%	7.30%	7.08%	7.32%
>180	7.54%	7.44%	7.42%	7.49%
Total	**7.04%**	**7.04%**	**6.25%**	**6.77%**

[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

	12 – 16 dic.				19 - 23 dic.				26 - 30 dic.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	14	41	735	863	62	390	7689	8730	17	192	3401	3649
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	644	553	0	0	5390	4397	0	0	2264	2230
Otros[c]	41	14	86	49	390	62	595	539	192	17	446	220
Total	**55**	**55**	**1465**	**1465**	**452**	**452**	**13674**	**13666**	**209**	**209**	**6111**	**6099**

[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.