INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 22 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$1488 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.66%[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	278,4	165,6	116,9	233,5	16,2	12,4	32,5
15-35	466,8	427,5	314,2	379,2	42,7	17,1	70,5
36-60	45,5	22,5	13,6	30,1	8,9	15,4	0,0
61-90	3,6	66,0	30,4	1,5	35,6	2,1	0,0
91-180	18,6	91,9	51,8	0,0	25,1	3,6	15,0
>180	10,6	9,0	2,1	9,6	6,9	1,0	0,0
Total	**823,5**	**782,4**	**529,0**	**653,9**	**135,5**	**51,5**	**118,0**

[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	7.05%	6.11%	5.35%	6.02%
15-35	6.76%	6.59%	6.66%	6.65%
36-60	–	7.22%	6.91%	6.96%
61-90	–	7.20%	7.04%	7.19%
91-180	7.57%	7.42%	6.79%	7.42%
>180	–	7.95%	7.70%	7.80%
Total	**6.94%**	**6.72%**	**6.53%**	**6.66%**

[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

	19 – 23 dic.				26 - 30 dic.				02 - 06 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
Sectores	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero[a]	10	268	2913	3128	22	192	3616	3993	3	80	3150	3454
Intragrupo y off-shore[b]	0	0	2193	2001	0	0	2542	2362	0	0	2220	2034
Otros[c]	268	10	237	207	192	22	455	245	80	3	281	136
Total	**278**	**278**	**5343**	**5336**	**214**	**214**	**6613**	**6600**	**83**	**83**	**5651**	**5624**

[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.