

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2022
Fecha de Información: 07 de julio 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\$3702 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.97%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 450,5 | 642,6 | 96,2 | 320,8 | 510,1 | 93,5 | 36,2 |
| 15-35 | 669,3 | 641,2 | 516,6 | 516,1 | 50,6 | 79,2 | 74,0 |
| 36-60 | 151,5 | 10,4 | 0,0 | 1,0 | 10,4 | 150,4 | 0,0 |
| 61-90 | 345,2 | 322,2 | 267,9 | 0,0 | 44,3 | 335,2 | 10,0 |
| 91-180 | 133,5 | 282,0 | 209,4 | 85,0 | 27,6 | 3,4 | 45,0 |
| >180 | 154,0 | 124,9 | 60,0 | 85,8 | 4,9 | 8,1 | 60,0 |
| Total | 1903,9 | 2023,3 | 1150,1 | 1008,8 | 648,0 | 669,8 | 225,2 |

^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 | 6.33% | 4.40% | 7.07% | 5.45% |
| 15-35 | 6.30% | 6.47% | 6.22% | 6.36% |
| 36-60 | — | 6.61% | 6.36% | 6.38% |
| 61-90 | 6.45% | 6.49% | 6.18% | 6.24% |
| 91-180 | 6.56% | 6.02% | 6.42% | 6.20% |
| >180 | 6.68% | 7.06% | 3.62% | 6.61% |
| Total | 6.47% | 5.39% | 6.49% | 5.97% |

^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 | 04 – 08 jul. | | | | 11 - 15 jul. | | | | 18 - 22 jul. | | | |
|-------------------------------------|--------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 18 | 77 | 3135 | 3306 | 75 | 221 | 6774 | 7521 | 36 | 183 | 3944 | 4311 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 1949 | 1927 | 0 | 0 | 3910 | 3198 | 0 | 0 | 2708 | 1636 |
| Otros ^c | 77 | 18 | 419 | 221 | 220 | 75 | 2040 | 1854 | 183 | 36 | 530 | 1199 |
| Total | 95 | 95 | 5503 | 5454 | 295 | 296 | 12724 | 12573 | 219 | 219 | 7182 | 7146 |

^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.