

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de julio de 2022
Fecha de Información: 19 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\$4344 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.82%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 1188,0 | 883,8 | 241,0 | 867,6 | 345,8 | 23,4 | 297 |
| 15-35 | 535,8 | 1371,7 | 1136,7 | 299,0 | 78,0 | 79,8 | 157 |
| 36-60 | 119,3 | 17,9 | 3,1 | 0,0 | 14,8 | 119,3 | 0 |
| 61-90 | 205,2 | 178,0 | 0,0 | 10,0 | 8,0 | 25,2 | 170 |
| 91-180 | 412,6 | 218,3 | 10,0 | 5,1 | 12,3 | 211,5 | 196 |
| >180 | 9,6 | 23,4 | 15,0 | 3,1 | 8,4 | 6,5 | 0 |
| Total | 2470,6 | 2693,2 | 1405,9 | 1184,8 | 467,3 | 465,8 | 820 |

^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 | 6.32% | 3.29% | 5.87% | 5.18% |
| 15-35 | 6.29% | 6.07% | 6.09% | 6.10% |
| 36-60 | — | 6.71% | 6.40% | 6.44% |
| 61-90 | 6.58% | 6.79% | 6.50% | 6.58% |
| 91-180 | 6.64% | 7.00% | 6.16% | 6.41% |
| >180 | — | 7.52% | 7.34% | 7.48% |
| Total | 6.44% | 5.27% | 6.02% | 5.82% |

^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 | 18 – 22 jul. | | | | 25 - 29 jul. | | | | 01 - 05 ago. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 35 | 153 | 3953 | 4283 | 37 | 268 | 7508 | 7841 | 32 | 136 | 6221 | 6366 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2137 | 2120 | 0 | 0 | 4491 | 3499 | 0 | 0 | 4171 | 3254 |
| Otros ^c | 153 | 35 | 1187 | 840 | 268 | 37 | 1293 | 1886 | 136 | 32 | 295 | 1013 |
| Total | 188 | 188 | 7277 | 7243 | 305 | 305 | 13292 | 13226 | 168 | 168 | 10687 | 10633 |

^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.