

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de agosto de 2022
Fecha de Información: 12 de agosto 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\$2885 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.19%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 | 649,4 | 786,6 | 81,3 | 357,2 | 501,0 | 88,0 | 204,3 |
| 15-35 | 483,5 | 614,6 | 323,1 | 294,2 | 134,7 | 0,0 | 189,3 |
| 36-60 | 53,1 | 53,0 | 0,0 | 0,0 | 48,9 | 49,1 | 4,0 |
| 61-90 | 42,9 | 81,3 | 21,9 | 20,0 | 39,3 | 2,9 | 20,0 |
| 91-180 | 401,3 | 118,2 | 0,0 | 5,0 | 78,2 | 356,3 | 40,0 |
| >180 | 17,3 | 41,3 | 28,6 | 0,2 | 12,7 | 17,1 | 0,0 |
| Total | 1647,5 | 1694,9 | 454,9 | 676,6 | 814,9 | 513,3 | 457,6 |

^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 | 6.41% | 2.19% | 4.27% | 3.57% |
| 15-35 | 6.38% | 6.26% | 6.05% | 6.22% |
| 36-60 | 6.30% | 6.66% | 6.34% | 6.49% |
| 61-90 | 6.60% | 6.58% | 6.57% | 6.58% |
| 91-180 | 6.81% | 7.00% | 5.96% | 6.20% |
| >180 | — | 7.25% | 7.12% | 7.21% |
| Total | 6.45% | 4.49% | 5.47% | 5.19% |

^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 | 08 – 12 ago. | | | | 15 - 19 ago. | | | | 22 - 26 ago. | | | |
|-------------------------------------|--------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 31 | 60 | 1613 | 1796 | 22 | 229 | 4832 | 5624 | 26 | 231 | 3799 | 4683 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 661 | 447 | 0 | 0 | 3351 | 2687 | 0 | 0 | 2197 | 1329 |
| Otros ^c | 60 | 31 | 788 | 808 | 228 | 22 | 965 | 780 | 231 | 26 | 1195 | 1152 |
| Total | 91 | 91 | 3062 | 3051 | 250 | 251 | 9148 | 9091 | 257 | 257 | 7191 | 7164 |

^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.