

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2022
Fecha de Información: 18 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\$2160 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.34%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 | 676,5 | 465,3 | 142,4 | 415,2 | 127,8 | 66,2 | 195,1 |
| 15-35 | 373,5 | 778,6 | 606,0 | 117,6 | 57,5 | 0,0 | 255,9 |
| 36-60 | 133,0 | 7,1 | 0,0 | 0,0 | 7,1 | 133,0 | 0,0 |
| 61-90 | 38,7 | 76,2 | 30,0 | 0,0 | 26,2 | 18,7 | 20,0 |
| 91-180 | 26,8 | 12,7 | 0,0 | 7,5 | 12,7 | 19,3 | 0,0 |
| >180 | 24,3 | 28,1 | 13,0 | 2,4 | 5,1 | 11,9 | 10,0 |
| Total | 1272,9 | 1367,9 | 791,4 | 542,7 | 236,3 | 249,2 | 481,0 |

^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

| Rango | Intermediarios del Mercado Cambiario ^a | | Otros Agentes sin intragrupo | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 6.87% | | 6.52% | 5.30% | 6.19% |
| 15-35 | 6.51% | | 6.27% | 6.48% | 6.37% |
| 36-60 | — | | 6.67% | 6.38% | 6.40% |
| 61-90 | 6.49% | | 6.85% | 6.43% | 6.67% |
| 91-180 | — | | 7.04% | 6.62% | 6.79% |
| >180 | 6.99% | | 7.13% | 6.81% | 6.96% |
| Total | 6.73% | | 6.42% | 6.04% | 6.34% |

^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 | 15 – 19 ago. | | | | 22 - 26 ago. | | | | 29 ago. - 02 sep. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 20 | 149 | 3325 | 3213 | 37 | 236 | 4792 | 5857 | 31 | 181 | 6489 | 6439 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2122 | 2025 | 1 | 0 | 2402 | 1648 | 0 | 0 | 3968 | 3250 |
| Otros ^c | 149 | 20 | 440 | 605 | 236 | 37 | 1595 | 1252 | 181 | 31 | 723 | 1456 |
| Total | 169 | 169 | 5887 | 5843 | 274 | 273 | 8789 | 8757 | 212 | 212 | 11180 | 11145 |

^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.