

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de octubre de 2022
Fecha de Información: 03 de octubre 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\$1923 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.03%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 | 276,6 | 281,3 | 183,1 | 194,4 | 53,7 | 37,8 | 44,4 |
| 15-35 | 534,8 | 622,8 | 316,1 | 221,8 | 39,4 | 45,6 | 267,3 |
| 36-60 | 159,3 | 138,0 | 35,7 | 42,3 | 41,3 | 56,0 | 61,0 |
| 61-90 | 12,5 | 10,8 | 7,6 | 7,0 | 3,2 | 5,5 | 0,0 |
| 91-180 | 78,3 | 74,6 | 37,0 | 45,0 | 22,6 | 18,3 | 15,0 |
| >180 | 52,4 | 69,4 | 65,0 | 50,0 | 4,4 | 2,4 | 0,0 |
| Total | 1113,8 | 1196,9 | 644,6 | 560,5 | 164,6 | 165,5 | 387,7 |

^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 | 7.04% | 7.05% | 6.92% | 6.99% |
| 15-35 | 7.01% | 7.01% | 6.93% | 6.99% |
| 36-60 | 7.01% | 7.12% | 7.03% | 7.05% |
| 61-90 | — | 4.85% | 6.95% | 6.17% |
| 91-180 | 7.07% | 7.13% | 6.92% | 7.08% |
| >180 | — | 7.35% | 7.49% | 7.42% |
| Total | 7.01% | 7.06% | 7.00% | 7.03% |

^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 | 03 – 07 oct. | | | | 10 - 14 oct. | | | | 17 - 21 oct. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 57 | 151 | 6949 | 8246 | 52 | 142 | 4353 | 5246 | 17 | 143 | 3644 | 4283 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 4814 | 3072 | 0 | 0 | 3432 | 1763 | 0 | 0 | 2024 | 865 |
| Otros ^c | 151 | 57 | 1339 | 1759 | 142 | 52 | 545 | 1284 | 143 | 17 | 479 | 977 |
| Total | 208 | 208 | 13102 | 13077 | 194 | 194 | 8330 | 8293 | 160 | 160 | 6147 | 6125 |

^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.