

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 31 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\$2774 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.36%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 | 569,1 | 316,2 | 163,7 | 395,8 | 73,0 | 93,9 | 79,5 |
| 15-35 | 709,2 | 743,6 | 373,9 | 389,2 | 154,7 | 105,0 | 215,0 |
| 36-60 | 124,3 | 232,4 | 179,0 | 76,8 | 18,4 | 12,4 | 35,0 |
| 61-90 | 7,4 | 18,5 | 0,0 | 0,0 | 18,5 | 7,4 | 0,0 |
| 91-180 | 238,2 | 95,8 | 20,0 | 164,0 | 25,8 | 24,2 | 50,0 |
| >180 | 1,0 | 98,1 | 97,1 | 0,0 | 1,0 | 1,0 | 0,0 |
| Total | 1649,2 | 1504,5 | 833,7 | 1025,8 | 291,3 | 243,9 | 379,5 |

^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 | 6.76% | | 6.70% | 5.81% | 6.13% |
| 15-35 | 6.72% | | 6.69% | 6.70% | 6.70% |
| 36-60 | 6.89% | | 5.19% | 7.03% | 5.53% |
| 61-90 | — | | 7.31% | 7.00% | 7.22% |
| 91-180 | 7.08% | | 7.38% | 5.91% | 6.31% |
| >180 | — | | 7.97% | 7.41% | 7.68% |
| Total | 6.79% | | 6.38% | 6.17% | 6.36% |

^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 | 31 oct. - 04 nov. | | | | 07 - 11 nov. | | | | 14 - 18 nov. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 67 | 147 | 7132 | 7321 | 39 | 178 | 5342 | 6164 | 36 | 155 | 5610 | 4797 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 4439 | 3354 | 1 | 0 | 4303 | 2671 | 0 | 0 | 3177 | 2850 |
| Otros ^c | 147 | 67 | 1038 | 1878 | 177 | 39 | 534 | 1221 | 155 | 36 | 829 | 1941 |
| Total | 214 | 214 | 12609 | 12553 | 217 | 217 | 10179 | 10056 | 191 | 191 | 9616 | 9588 |

^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.