

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de diciembre de 2022
Fecha de Información: 01 de diciembre 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\$2118 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.76%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 | 453,6 | 401,8 | 130,9 | 284,9 | 116,9 | 14,7 | 154,0 |
| 15-35 | 547,0 | 563,5 | 362,9 | 380,5 | 69,6 | 35,6 | 131,0 |
| 36-60 | 75,5 | 60,4 | 7,0 | 1,1 | 49,0 | 70,0 | 4,5 |
| 61-90 | 16,3 | 47,7 | 5,0 | 5,0 | 32,7 | 1,3 | 10,0 |
| 91-180 | 44,9 | 85,1 | 0,9 | 0,0 | 52,2 | 12,9 | 32,0 |
| >180 | 80,0 | 83,3 | 40,3 | 70,0 | 33,0 | 0,0 | 10,0 |
| Total | 1217,3 | 1242,0 | 547,1 | 741,4 | 353,5 | 134,5 | 341,4 |

^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 | 5.57% | 6.79% | 6.67% | 6.32% |
| 15-35 | 6.82% | 6.81% | 6.64% | 6.74% |
| 36-60 | 6.70% | 6.98% | 6.78% | 6.86% |
| 61-90 | 6.99% | 7.10% | 6.94% | 7.06% |
| 91-180 | 7.15% | 7.38% | 6.99% | 7.25% |
| >180 | 7.38% | 7.50% | 7.82% | 7.64% |
| Total | 6.30% | 6.96% | 6.81% | 6.76% |

^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 | 28 nov. - 02 dic. | | | | 05 - 09 dic. | | | | 12 - 16 dic. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 10 | 116 | 3144 | 3080 | 21 | 190 | 5085 | 5941 | 48 | 186 | 6613 | 7912 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 1545 | 1793 | 0 | 0 | 2595 | 2028 | 1 | 0 | 4593 | 2994 |
| Otros ^c | 116 | 10 | 733 | 512 | 190 | 21 | 1634 | 1274 | 185 | 48 | 693 | 665 |
| Total | 126 | 126 | 5422 | 5385 | 211 | 211 | 9314 | 9243 | 234 | 234 | 11899 | 11571 |

^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.