

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2022

Fecha de Información: 20 de septiembre 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\$1976 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.20%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragruppo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|--------------|---------------|-------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 674,8 | 819,5 | 39,0 | 167,2 | 291,5 | 18,6 | 489 |
| 15-35 | 385,0 | 479,2 | 222,5 | 147,5 | 33,8 | 14,5 | 223 |
| 36-60 | 92,2 | 46,3 | 0,0 | 0,0 | 11,3 | 57,2 | 35 |
| 61-90 | 0,7 | 73,9 | 0,0 | 0,0 | 73,9 | 0,7 | 0 |
| 91-180 | 55,3 | 93,3 | 55,8 | 32,0 | 17,5 | 3,3 | 20 |
| >180 | 18,9 | 8,5 | 0,0 | 10,0 | 3,5 | 3,9 | 5 |
| Total | 1226,9 | 1520,7 | 317,3 | 356,7 | 431,4 | 98,3 | 772 |

^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 | 7.32% | | 7.09% | 6.85% | 7.20% |
| 15-35 | 7.18% | | 7.15% | 7.01% | 7.13% |
| 36-60 | 7.24% | | 7.46% | 7.07% | 7.17% |
| 61-90 | - | | 7.41% | 6.64% | 7.40% |
| 91-180 | 7.36% | | 7.65% | 7.15% | 7.47% |
| >180 | 7.71% | | 8.27% | 7.27% | 7.72% |
| Total | 7.28% | | 7.18% | 6.98% | 7.20% |

^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.

¹A 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.

²El 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 | 19 – 23 sep. | | | | 26 - 30 sep. | | | | 03 - 07 oct. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 27 | 161 | 5561 | 5966 | 25 | 204 | 7072 | 7806 | 20 | 140 | 5683 | 6318 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 1 | 0 | 2771 | 2870 | 0 | 0 | 3883 | 3451 | 0 | 0 | 4136 | 2527 |
| Otros ^c | 160 | 27 | 1476 | 949 | 204 | 25 | 1551 | 1225 | 140 | 20 | 571 | 1520 |
| Total | 188 | 188 | 9808 | 9785 | 229 | 229 | 12506 | 12482 | 160 | 160 | 10390 | 10365 |

^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.