

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2022
Fecha de Información: 16 de noviembre 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\$5260 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.21%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 | 419,1 | 1097,3 | 286,3 | 214,5 | 694,6 | 88,1 | 116,5 |
| 15-35 | 723,0 | 560,5 | 335,2 | 469,6 | 32,9 | 61,0 | 192,4 |
| 36-60 | 2,8 | 489,5 | 480,0 | 0,5 | 9,5 | 2,3 | 0,0 |
| 61-90 | 448,9 | 7,6 | 0,0 | 83,6 | 7,6 | 365,3 | 0,0 |
| 91-180 | 445,2 | 657,7 | 560,0 | 58,3 | 37,3 | 326,6 | 60,4 |
| >180 | 746,0 | 46,8 | 30,0 | 728,0 | 1,8 | 3,0 | 15,0 |
| Total | 2785,0 | 2859,5 | 1691,4 | 1554,5 | 783,7 | 846,2 | 384,3 |

^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 | 6.56% | | 5.03% | 6.42% | 5.48% |
| 15-35 | 6.49% | | 6.58% | 6.51% | 6.54% |
| 36-60 | - | | 6.76% | 6.43% | 6.70% |
| 61-90 | - | | 7.07% | 6.65% | 6.66% |
| 91-180 | 7.12% | | 6.65% | 6.82% | 6.80% |
| >180 | 7.29% | | 7.26% | 7.22% | 7.27% |
| Total | 6.64% | | 5.69% | 6.63% | 6.21% |

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 14 – 18 nov. | | | | 21 - 25 nov. | | | | 28 nov. - 02 dic. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 36 | 106 | 6024 | 5895 | 14 | 185 | 6195 | 7642 | 23 | 220 | 4939 | 5027 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3737 | 3313 | 2 | 0 | 4321 | 3197 | 0 | 0 | 2908 | 2119 |
| Otros ^c | 106 | 36 | 890 | 1416 | 183 | 14 | 1827 | 1453 | 220 | 23 | 813 | 1469 |
| Total | 142 | 142 | 10651 | 10624 | 199 | 199 | 12343 | 12292 | 243 | 243 | 8660 | 8615 |

^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.