

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 07 de julio de 2023
Fecha de Información: 05 de julio de 2023¹

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\$5065 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.08%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 | 1088,8 | 1292,0 | 299,4 | 780,9 | 699,1 | 14,4 | 293,5 |
| 15-35 | 647,4 | 1121,0 | 880,3 | 353,7 | 37,2 | 90,1 | 203,6 |
| 36-60 | 658,3 | 12,0 | 0,0 | 40,0 | 12,0 | 618,3 | 0,0 |
| 61-90 | 26,4 | 25,0 | 0,0 | 9,1 | 19,0 | 11,4 | 6,0 |
| 91-180 | 46,1 | 206,3 | 84,0 | 0,0 | 80,8 | 4,6 | 41,5 |
| >180 | 255,2 | 248,7 | 217,5 | 184,5 | 13,5 | 52,9 | 17,7 |
| Total | 2722,2 | 2905,0 | 1481,2 | 1368,2 | 861,5 | 791,7 | 562,3 |

^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 | 11.57% | 9.21% | 8.18% | 9.15% |
| 15-35 | 11.78% | 11.49% | 11.67% | 11.58% |
| 36-60 | — | 11.25% | 10.57% | 10.59% |
| 61-90 | 10.19% | 9.82% | 9.80% | 9.87% |
| 91-180 | 9.42% | 9.01% | 9.23% | 9.14% |
| >180 | 8.23% | 8.25% | 8.33% | 8.28% |
| Total | 11.37% | 10.12% | 9.63% | 10.08% |

^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 | 03 – 07 jul. | | | | 10 - 14 jul. | | | | 17 - 21 jul. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 47 | 169 | 5445 | 5783 | 90 | 232 | 6659 | 6711 | 23 | 223 | 5728 | 6266 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3666 | 3299 | 0 | 0 | 3180 | 2783 | 0 | 0 | 4336 | 2646 |
| Otros ^c | 169 | 47 | 753 | 782 | 232 | 90 | 1130 | 1468 | 223 | 23 | 398 | 1546 |
| Total | 216 | 216 | 9864 | 9864 | 322 | 322 | 10969 | 10962 | 246 | 246 | 10462 | 10458 |

^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.