

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2023
Fecha de Información: 06 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\$4326 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9.90%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 | 846,5 | 1151,8 | 445,0 | 430,1 | 322,2 | 31,7 | 384,7 |
| 15-35 | 709,9 | 1366,0 | 991,9 | 273,3 | 11,6 | 74,1 | 362,5 |
| 36-60 | 263,5 | 14,1 | 0,0 | 0,0 | 14,1 | 263,5 | 0,0 |
| 61-90 | 438,3 | 40,9 | 10,0 | 412,6 | 20,1 | 14,8 | 10,8 |
| 91-180 | 101,9 | 55,1 | 12,6 | 29,0 | 27,5 | 57,9 | 15,0 |
| >180 | 78,3 | 56,0 | 20,0 | 45,5 | 13,0 | 9,8 | 23,0 |
| Total | 2438,4 | 2684,0 | 1479,5 | 1190,5 | 408,5 | 451,9 | 796,0 |

^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 | 11.35% | | 7.70% | 9.36% | 9.09% |
| 15-35 | 11.04% | | 11.45% | 11.26% | 11.25% |
| 36-60 | - | | 11.19% | 9.66% | 9.73% |
| 61-90 | 10.33% | | 10.00% | 8.85% | 9.71% |
| 91-180 | 9.46% | | 9.81% | 9.32% | 9.46% |
| >180 | 8.04% | | 8.38% | 6.92% | 7.89% |
| Total | 11.06% | | 9.13% | 9.88% | 9.90% |

^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 | 21 | 83 | 3337 | 3261 | 96 | 239 | 6881 | 7285 | 25 | 223 | 5878 | 6536 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2187 | 2320 | 0 | 0 | 3273 | 2821 | 0 | 0 | 4549 | 2735 |
| Otros ^c | 83 | 21 | 117 | 59 | 239 | 96 | 1441 | 1482 | 223 | 25 | 402 | 1554 |
| Total | 104 | 104 | 5641 | 5640 | 335 | 335 | 11595 | 11588 | 248 | 248 | 10829 | 10825 |

^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.