

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 30 de enero de 2023
Fecha de Información: 26 de enero 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\$4269 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.68%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 | 1059,2 | 822,7 | 466,5 | 809,2 | 192,3 | 86,1 | 163,9 |
| 15-35 | 986,9 | 1175,8 | 782,7 | 597,3 | 60,8 | 57,3 | 332,3 |
| 36-60 | 212,3 | 114,1 | 97,2 | 40,0 | 16,9 | 172,3 | 0,0 |
| 61-90 | 127,1 | 104,3 | 40,0 | 110,0 | 49,3 | 2,1 | 15,0 |
| 91-180 | 40,0 | 103,8 | 6,0 | 0,0 | 57,7 | 0,0 | 40,0 |
| >180 | 28,0 | 60,6 | 13,2 | 10,0 | 32,4 | 3,0 | 15,0 |
| Total | 2453,5 | 2381,3 | 1405,7 | 1566,5 | 409,5 | 320,8 | 566,1 |

^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 | 7.69% | | 7.76% | 7.60% | 7.69% |
| 15-35 | 7.73% | | 7.49% | 7.58% | 7.59% |
| 36-60 | - | | 8.01% | 7.93% | 7.95% |
| 61-90 | 7.96% | | 7.28% | 7.42% | 7.43% |
| 91-180 | 8.02% | | 8.27% | 7.61% | 8.17% |
| >180 | 7.96% | | 8.19% | 8.05% | 8.11% |
| Total | 7.75% | | 7.69% | 7.63% | 7.68% |

^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 | 23 – 27 ene. | | | | 30 ene. - 03 feb. | | | | 06 - 10 feb. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 13 | 104 | 4480 | 4441 | 27 | 182 | 6295 | 6568 | 10 | 198 | 6000 | 5060 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3017 | 2820 | 0 | 0 | 2980 | 2986 | 0 | 0 | 2768 | 3013 |
| Otros ^c | 104 | 13 | 734 | 967 | 182 | 27 | 1885 | 1591 | 198 | 10 | 386 | 1035 |
| Total | 117 | 117 | 8231 | 8228 | 209 | 209 | 11160 | 11145 | 208 | 208 | 9154 | 9108 |

^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.