

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de marzo de 2023
Fecha de Información: 06 de marzo 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\$4858 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.15%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 | 1335,3 | 1466,3 | 868,9 | 1034,7 | 334,0 | 37,3 | 263,3 |
| 15-35 | 694,0 | 718,1 | 311,1 | 329,1 | 65,9 | 23,8 | 341,1 |
| 36-60 | 359,6 | 149,4 | 29,2 | 184,0 | 40,6 | 95,9 | 79,7 |
| 61-90 | 0,5 | 35,1 | 0,0 | 0,0 | 35,1 | 0,5 | 0,0 |
| 91-180 | 266,4 | 289,7 | 140,0 | 25,0 | 74,7 | 166,4 | 75,0 |
| >180 | 161,4 | 191,1 | 112,3 | 90,0 | 28,8 | 21,4 | 50,0 |
| Total | 2817,2 | 2849,6 | 1461,4 | 1662,8 | 579,0 | 345,2 | 809,2 |

^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 | 8.04% | | 6.60% | 5.52% | 6.38% |
| 15-35 | 8.00% | | 8.05% | 7.91% | 8.00% |
| 36-60 | 7.92% | | 8.21% | 7.81% | 7.91% |
| 61-90 | - | | 8.13% | 7.82% | 8.13% |
| 91-180 | 7.87% | | 7.86% | 7.55% | 7.74% |
| >180 | 7.70% | | 7.83% | 7.72% | 7.76% |
| Total | 7.97% | | 7.23% | 6.57% | 7.15% |

^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 | 06 – 10 mar. | | | | 13 - 17 mar. | | | | 20 - 24 mar. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 44 | 161 | 10686 | 10119 | 55 | 206 | 8938 | 11015 | 28 | 149 | 5050 | 4392 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 4836 | 4557 | 0 | 10 | 6548 | 3704 | 0 | 0 | 1928 | 1618 |
| Otros ^c | 161 | 44 | 1407 | 2019 | 206 | 45 | 908 | 1647 | 149 | 28 | 566 | 1525 |
| Total | 205 | 205 | 16929 | 16695 | 261 | 261 | 16394 | 16366 | 177 | 177 | 7544 | 7535 |

^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.