

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2023
Fecha de Información: 16 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\$4330 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 | 640,7 | 672,1 | 222,5 | 411,2 | 263,6 | 43,6 | 186,0 |
| 15-35 | 843,1 | 1704,2 | 1415,6 | 323,6 | 7,2 | 238,1 | 281,5 |
| 36-60 | 9,7 | 3,6 | 0,0 | 4,1 | 3,6 | 5,6 | 0,0 |
| 61-90 | 134,3 | 65,0 | 30,0 | 70,0 | 5,0 | 34,3 | 30,0 |
| 91-180 | 97,8 | 38,7 | 2,0 | 64,4 | 26,7 | 23,5 | 10,0 |
| >180 | 565,7 | 102,3 | 37,0 | 516,1 | 25,3 | 9,6 | 40,0 |
| Total | 2291,4 | 2585,9 | 1707,1 | 1389,3 | 331,4 | 354,6 | 547,5 |

^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 | 7.93% | | 8.05% | 5.78% | 7.08% |
| 15-35 | 8.20% | | 7.96% | 8.07% | 8.04% |
| 36-60 | - | | 8.30% | 7.94% | 8.04% |
| 61-90 | 8.00% | | 8.05% | 7.98% | 8.00% |
| 91-180 | 7.92% | | 8.00% | 7.81% | 7.88% |
| >180 | 7.75% | | 8.06% | 7.54% | 7.73% |
| Total | 8.06% | | 8.00% | 7.08% | 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 13 - 17 mar. | | | | 20 - 24 mar. | | | | 27 - 31 mar. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 28 | 105 | 5234 | 5773 | 38 | 162 | 6554 | 6677 | 43 | 201 | 5381 | 6340 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 10 | 3399 | 2712 | 0 | 0 | 2573 | 2155 | 0 | 0 | 4015 | 2160 |
| Otros ^c | 105 | 18 | 806 | 950 | 162 | 38 | 1443 | 1723 | 201 | 43 | 729 | 1570 |
| Total | 133 | 133 | 9439 | 9435 | 200 | 200 | 10570 | 10555 | 244 | 244 | 10125 | 10070 |

^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.