

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de abril de 2023
Fecha de Información: 31 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\$3718 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.66%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragruppo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 358,3 | 715,4 | 204,1 | 110,8 | 0,0 | 85,1 | 162,5 |
| 15-35 | 1072,1 | 822,7 | 508,0 | 736,1 | 35,3 | 0,0 | 336,1 |
| 36-60 | 9,6 | 14,1 | 0,0 | 0,0 | 14,0 | 9,6 | 0,0 |
| 61-90 | 391,1 | 82,3 | 5,0 | 35,0 | 77,3 | 356,1 | 0,0 |
| 91-180 | 34,3 | 48,0 | 0,0 | 10,0 | 28,0 | 4,3 | 20,0 |
| >180 | 181,9 | 556,8 | 501,4 | 127,0 | 5,4 | 4,9 | 50,0 |
| Total | 2047,2 | 2239,3 | 1218,6 | 1018,8 | 159,9 | 459,9 | 568,5 |

^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 | 7.77% | 4.73% | Inf% | 5.98% |
| 15-35 | 7.78% | 7.34% | 5.47% | 6.51% |
| 36-60 | – | 8.01% | 7.45% | 7.78% |
| 61-90 | – | 7.93% | 7.36% | 7.46% |
| 91-180 | 7.71% | 8.01% | 7.72% | 7.85% |
| >180 | 7.63% | 7.05% | 7.21% | 7.11% |
| Total | 7.76% | 6.55% | 6.34% | 6.66% |

^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 | 27 – 31 mar. | | | | 03 - 07 abr. | | | | 10 - 14 abr. | | | |
|--------------------------------------|--------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 16 | 24 | 2066 | 2070 | 42 | 102 | 6496 | 6846 | 29 | 179 | 8950 | 10065 |
| Intragruppo y off-shore ^b | 0 | 0 | 1172 | 1133 | 0 | 0 | 3210 | 2968 | 0 | 0 | 4899 | 3365 |
| Otros ^c | 24 | 16 | 497 | 532 | 102 | 42 | 518 | 399 | 179 | 29 | 1250 | 1652 |
| Total | 40 | 40 | 3735 | 3735 | 144 | 144 | 10224 | 10213 | 208 | 208 | 15099 | 15082 |

^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.