

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de enero de 2023
Fecha de Información: 29 de diciembre de 2022¹

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\$3096 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.65%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|---------------|---------------|-------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 1161,3 | 113,4 | 44,4 | 1090,5 | 7,0 | 8,8 | 62 |
| 15-35 | 343,0 | 517,1 | 419,2 | 263,6 | 87,8 | 69,4 | 10 |
| 36-60 | 15,5 | 10,7 | 0,0 | 0,0 | 10,7 | 15,5 | 0 |
| 61-90 | 33,5 | 87,9 | 56,0 | 10,0 | 11,9 | 3,5 | 20 |
| 91-180 | 1,2 | 829,1 | 798,4 | 0,0 | 30,8 | 1,2 | 0 |
| >180 | 35,7 | 59,4 | 15,6 | 15,6 | 23,8 | 0,1 | 20 |
| Total | 1590,2 | 1617,6 | 1333,6 | 1379,7 | 172,1 | 98,5 | 112 |

^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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 6.13% | | 4.21% | 4.98% | 5.69% |
| 15-35 | 6.12% | | 6.57% | 6.38% | 6.44% |
| 36-60 | – | | 6.94% | 6.67% | 6.78% |
| 61-90 | 7.00% | | 7.08% | 6.77% | 7.05% |
| 91-180 | – | | 7.29% | 6.95% | 7.29% |
| >180 | 7.56% | | 7.71% | 7.78% | 7.68% |
| Total | 6.54% | | 6.91% | 6.41% | 6.65% |

^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.

¹ A 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.

² El 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 | 26 – 30 dic. | | | | 02 - 06 ene. | | | | 09 - 13 ene. | | | |
|-------------------------------------|--------------|-----------|------------|------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 5 | 34 | 212 | 242 | 12 | 90 | 3343 | 3609 | 27 | 151 | 5377 | 5153 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 66 | 105 | 0 | 0 | 2300 | 2149 | 0 | 0 | 3448 | 3777 |
| Otros ^c | 34 | 5 | 129 | 52 | 90 | 12 | 305 | 165 | 151 | 27 | 368 | 216 |
| Total | 39 | 39 | 407 | 399 | 102 | 102 | 5948 | 5923 | 178 | 178 | 9193 | 9146 |

^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.