

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2023

Fecha de Información: 19 de septiembre 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\$4500 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10.29%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 | 963,1 | 812,5 | 149,3 | 527,4 | 349,2 | 121,7 | 314,0 |
| 15-35 | 1094,2 | 1469,7 | 598,9 | 345,0 | 129,7 | 8,1 | 741,1 |
| 36-60 | 547,2 | 257,8 | 40,0 | 0,0 | 8,8 | 338,2 | 209,0 |
| 61-90 | 27,5 | 30,7 | 0,0 | 0,0 | 30,7 | 27,5 | 0,0 |
| 91-180 | 273,0 | 25,7 | 0,0 | 260,0 | 15,7 | 3,0 | 10,0 |
| >180 | 153,0 | 219,4 | 90,0 | 40,0 | 29,4 | 13,0 | 100,0 |
| Total | 3058,0 | 2815,8 | 878,2 | 1172,4 | 563,5 | 511,5 | 1374,1 |

^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 | 11.31% | 10.14% | 8.44% | 10.01% |
| 15-35 | 11.03% | 11.04% | 11.06% | 11.04% |
| 36-60 | 10.26% | 10.43% | 9.87% | 10.04% |
| 61-90 | – | 9.85% | 9.68% | 9.77% |
| 91-180 | 9.53% | 9.45% | 9.58% | 9.57% |
| >180 | 8.50% | 8.13% | 8.05% | 8.25% |
| Total | 10.78% | 10.39% | 9.66% | 10.29% |

^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 | 18 – 22 sep. | | | | 25 - 29 sep. | | | | 02 - 06 oct. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 20 | 219 | 4747 | 5586 | 58 | 243 | 8851 | 10872 | 45 | 96 | 6044 | 6090 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3404 | 2506 | 0 | 0 | 5397 | 3527 | 0 | 0 | 4071 | 2880 |
| Otros ^c | 219 | 20 | 447 | 497 | 243 | 58 | 2089 | 1917 | 96 | 45 | 626 | 1758 |
| Total | 239 | 239 | 8598 | 8589 | 301 | 301 | 16337 | 16316 | 141 | 141 | 10741 | 10728 |

^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.