

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 25 de octubre de 2023
Fecha de Información: 23 de octubre 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\$2917 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11.37%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 | 452,4 | 684,2 | 359,6 | 342,1 | 233,6 | 19,3 | 91 |
| 15-35 | 720,7 | 799,9 | 395,4 | 334,8 | 85,6 | 66,9 | 319 |
| 36-60 | 343,0 | 59,1 | 20,0 | 0,0 | 9,1 | 313,0 | 30 |
| 61-90 | 0,4 | 9,4 | 0,2 | 0,0 | 9,2 | 0,4 | 0 |
| 91-180 | 82,7 | 111,4 | 100,0 | 60,0 | 11,4 | 22,7 | 0 |
| >180 | 10,2 | 83,2 | 81,0 | 10,0 | 2,2 | 0,2 | 0 |
| Total | 1609,4 | 1747,3 | 956,2 | 746,9 | 351,1 | 422,4 | 440 |

^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 | 11.93% | 10.29% | 11.46% | 10.81% |
| 15-35 | 12.17% | 11.94% | 11.94% | 12.00% |
| 36-60 | 11.85% | 11.37% | 11.11% | 11.19% |
| 61-90 | – | 10.73% | 11.19% | 10.74% |
| 91-180 | – | 10.40% | 10.20% | 10.33% |
| >180 | – | 9.28% | 9.59% | 9.32% |
| Total | 12.10% | 10.98% | 11.43% | 11.37% |

^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 | 23 – 27 oct. | | | | 30 oct. - 03 nov. | | | | 06 - 10 nov. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 159 | 254 | 8125 | 9686 | 77 | 304 | 6508 | 8237 | 31 | 92 | 7206 | 7159 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 5642 | 3784 | 0 | 0 | 4637 | 2253 | 0 | 0 | 4380 | 2878 |
| Otros ^c | 254 | 159 | 1294 | 1584 | 304 | 77 | 1150 | 1805 | 92 | 31 | 364 | 1364 |
| Total | 413 | 413 | 15061 | 15054 | 381 | 381 | 12295 | 12295 | 123 | 123 | 11950 | 11401 |

^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.