

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de febrero de 2024
Fecha de Información: 01 de febrero de 2024¹

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\$2834 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.09%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 | 638,1 | 326,0 | 51,7 | 443,8 | 120,7 | 40,7 | 153,6 |
| 15-35 | 593,6 | 498,4 | 381,8 | 486,0 | 48,2 | 39,2 | 68,5 |
| 36-60 | 130,0 | 54,0 | 0,0 | 24,8 | 54,0 | 105,2 | 0,0 |
| 61-90 | 40,1 | 50,3 | 10,7 | 40,0 | 39,6 | 0,1 | 0,0 |
| 91-180 | 223,0 | 463,7 | 302,2 | 99,0 | 62,6 | 25,0 | 99,0 |
| >180 | 30,0 | 128,0 | 95,9 | 8,4 | 11,3 | 0,9 | 20,8 |
| Total | 1655,0 | 1520,5 | 842,2 | 1101,9 | 336,4 | 211,2 | 341,9 |

^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 | 7.23% | 7.20% | 7.54% | 7.35% |
| 15-35 | 6.88% | 7.05% | 7.02% | 7.02% |
| 36-60 | – | 7.36% | 6.98% | 7.10% |
| 61-90 | – | 7.27% | 6.18% | 6.72% |
| 91-180 | 6.99% | 7.07% | 6.98% | 7.03% |
| >180 | 6.80% | 6.63% | 5.81% | 6.68% |
| Total | 7.07% | 7.09% | 7.09% | 7.09% |

^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 | 29 ene. - 02 feb. | | | | 05 - 09 feb. | | | | 12 - 16 feb. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 12 | 41 | 4052 | 4121 | 66 | 119 | 6092 | 7126 | 97 | 156 | 6914 | 8001 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2470 | 2201 | 0 | 0 | 3837 | 2828 | 0 | 0 | 4756 | 2828 |
| Otros ^c | 41 | 12 | 289 | 475 | 119 | 66 | 1189 | 1105 | 156 | 97 | 555 | 1380 |
| Total | 53 | 53 | 6811 | 6797 | 185 | 185 | 11118 | 11059 | 253 | 253 | 12225 | 12209 |

^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.