

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 06 de febrero de 2024
Fecha de Información: 02 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\$3319 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.08%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 | 705,5 | 379,9 | 121,5 | 433,7 | 2,4 | 15,8 | 256,0 |
| 15-35 | 714,9 | 1440,5 | 924,7 | 196,4 | 12,3 | 15,0 | 503,5 |
| 36-60 | 253,2 | 5,0 | 0,0 | 240,0 | 5,0 | 13,2 | 0,0 |
| 61-90 | 161,8 | 146,6 | 55,0 | 60,2 | 6,6 | 16,5 | 85,0 |
| 91-180 | 4,5 | 14,5 | 10,0 | 0,0 | 4,5 | 4,5 | 0,0 |
| >180 | 128,6 | 236,0 | 204,4 | 99,2 | 3,6 | 1,5 | 28,0 |
| Total | 1968,5 | 2222,5 | 1315,7 | 1029,6 | 34,4 | 66,5 | 872,5 |

^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 | 7.29% | | 7.21% | 5.99% | 6.66% |
| 15-35 | 7.28% | | 7.49% | 6.60% | 7.31% |
| 36-60 | - | | 7.25% | 6.79% | 6.92% |
| 61-90 | 7.06% | | 7.11% | 7.07% | 7.07% |
| 91-180 | - | | 7.04% | 6.84% | 6.94% |
| >180 | 6.57% | | 6.09% | 5.89% | 6.29% |
| Total | 7.24% | | 7.40% | 6.28% | 7.08% |

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. 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 | 7 | 22 | 893 | 1016 | 74 | 119 | 6570 | 7305 | 100 | 156 | 7029 | 8127 |
| Intragruppo y off-shore ^b | 0 | 0 | 654 | 529 | 0 | 0 | 3931 | 3221 | 0 | 0 | 4770 | 2828 |
| Otros ^c | 22 | 7 | 37 | 38 | 119 | 74 | 1190 | 1106 | 156 | 100 | 555 | 1385 |
| Total | 29 | 29 | 1584 | 1583 | 193 | 193 | 11691 | 11632 | 256 | 256 | 12354 | 12340 |

^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.