

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2024

Fecha de Información: 19 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\$764 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.26%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

| Rango | Sector Financiero ² | | Intragrupo y Off-shore ³ | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|--------------|-------------------------------------|--------------|---------------|-------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 318,1 | 246,6 | 104,0 | 173,2 | 2,6 | 4,9 | 140 |
| 15-35 | 150,3 | 287,6 | 144,4 | 10,8 | 8,2 | 4,6 | 135 |
| 36-60 | 19,9 | 13,4 | 0,0 | 10,0 | 4,4 | 0,9 | 9 |
| 61-90 | 0,6 | 2,1 | 0,0 | 0,0 | 2,1 | 0,6 | 0 |
| 91-180 | 5,5 | 7,8 | 0,0 | 0,0 | 2,8 | 0,5 | 5 |
| >180 | 0,4 | 0,5 | 0,0 | 0,0 | 0,5 | 0,4 | 0 |
| Total | 494,8 | 558,1 | 248,4 | 194,0 | 20,7 | 11,8 | 289 |

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| Rango | Intermediarios del Mercado Cambiario ¹ | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|---|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 6.06% | 6.39% | 6.90% | 6.30% |
| 15-35 | 5.99% | 6.59% | 6.21% | 6.30% |
| 36-60 | 1.70% | 7.01% | 6.59% | 4.86% |
| 61-90 | – | 7.08% | 6.67% | 6.99% |
| 91-180 | 6.41% | 7.15% | 6.56% | 6.67% |
| >180 | – | 6.54% | 6.61% | 6.57% |
| Total | 5.90% | 6.53% | 6.76% | 6.26% |

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.

³Cifras en millones de dólares

²Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

³Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

¹Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 19 – 23 feb. | | | | 26 feb. - 01 mar. | | | | 04 - 08 mar. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 43 | 221 | 7393 | 7968 | 27 | 243 | 8878 | 9109 | 20 | 120 | 5990 | 6476 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 4626 | 3760 | 0 | 0 | 4908 | 4356 | 0 | 0 | 3163 | 2429 |
| Otros ^c | 221 | 43 | 877 | 1127 | 243 | 27 | 976 | 1283 | 120 | 20 | 395 | 639 |
| Total | 264 | 264 | 12896 | 12855 | 270 | 270 | 14762 | 14748 | 140 | 140 | 9548 | 9544 |

^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.