

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de marzo de 2024
Fecha de Información: 06 de marzo 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\$2865 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.48%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

| Rango | Sector Financiero ² | | Intragrupo y Off-shore ³ | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 653,6 | 626,5 | 239,5 | 403,5 | 186,9 | 50,0 | 200,1 |
| 15-35 | 900,3 | 607,0 | 182,5 | 427,8 | 22,3 | 70,3 | 402,2 |
| 36-60 | 227,4 | 192,6 | 10,0 | 0,0 | 32,6 | 77,4 | 150,0 |
| 61-90 | 84,2 | 137,9 | 55,1 | 20,0 | 27,7 | 9,2 | 55,0 |
| 91-180 | 67,6 | 128,5 | 33,0 | 0,0 | 30,5 | 2,6 | 65,0 |
| >180 | 28,0 | 108,4 | 70,0 | 0,0 | 13,4 | 3,0 | 25,0 |
| Total | 1961,1 | 1800,9 | 590,1 | 851,3 | 313,5 | 212,5 | 897,3 |

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 | 6.66% | | 6.39% | 6.57% | 6.52% |
| 15-35 | 6.57% | | 6.67% | 6.35% | 6.51% |
| 36-60 | 6.56% | | 6.82% | 6.46% | 6.56% |
| 61-90 | 6.39% | | 6.38% | 6.41% | 6.39% |
| 91-180 | 6.30% | | 6.41% | 6.00% | 6.32% |
| >180 | 5.78% | | 5.78% | 5.38% | 5.76% |
| Total | 6.54% | | 6.44% | 6.46% | 6.48% |

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.

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 | 04 - 08 mar. | | | | 11 - 15 mar. | | | | 18 - 22 mar. | | | |
|--------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 33 | 88 | 4860 | 4990 | 70 | 136 | 5808 | 6623 | 37 | 212 | 10993 | 11752 |
| Intragruppo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2538 | 2272 | 0 | 0 | 3558 | 2630 | 0 | 0 | 6569 | 5181 |
| Otros ^c | 88 | 33 | 220 | 356 | 136 | 70 | 630 | 716 | 212 | 37 | 630 | 1249 |
| Total | 121 | 121 | 7618 | 7618 | 206 | 206 | 9996 | 9969 | 249 | 249 | 18192 | 18182 |

^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.