

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2024
Fecha de Información: 12 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\$3305 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.76%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados³

| Rango | Sector Financiero ² | | Intragruppo y Off-shore ³ | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 738,4 | 943,8 | 272,0 | 182,1 | 245,1 | 129,5 | 426,8 |
| 15-35 | 660,0 | 840,9 | 271,6 | 162,7 | 128,2 | 56,2 | 441,1 |
| 36-60 | 354,2 | 161,9 | 0,0 | 164,5 | 5,7 | 33,5 | 156,2 |
| 61-90 | 0,4 | 18,5 | 0,0 | 0,0 | 18,5 | 0,4 | 0,0 |
| 91-180 | 406,2 | 235,1 | 54,8 | 10,0 | 10,3 | 226,2 | 170,0 |
| >180 | 16,8 | 123,2 | 119,6 | 12,8 | 3,6 | 4,0 | 0,0 |
| Total | 2176,0 | 2323,4 | 718,0 | 532,1 | 411,3 | 449,9 | 1194,0 |

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 | 6.16% | | 4.93% | 4.44% | 5.27% |
| 15-35 | 6.23% | | 6.15% | 5.87% | 6.14% |
| 36-60 | 6.25% | | 6.66% | 6.15% | 6.25% |
| 61-90 | - | | 6.38% | 6.00% | 6.37% |
| 91-180 | 6.17% | | 6.09% | 5.90% | 6.02% |
| >180 | - | | 6.10% | 5.43% | 5.92% |
| Total | 6.20% | | 5.49% | 5.34% | 5.76% |

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 | 11 - 15 mar. | | | | 18 - 22 mar. | | | | 25 - 29 mar. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 73 | 121 | 5838 | 6778 | 43 | 222 | 12257 | 13564 | 26 | 190 | 1722 | 2177 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3722 | 2461 | 0 | 0 | 7457 | 5889 | 0 | 0 | 838 | 611 |
| Otros ^c | 121 | 73 | 622 | 921 | 222 | 43 | 1018 | 1268 | 190 | 26 | 457 | 229 |
| Total | 194 | 194 | 10182 | 10160 | 265 | 265 | 20732 | 20721 | 216 | 216 | 3017 | 3017 |

^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.