

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de abril de 2022
Fecha de Información: 11 de abril de 2022¹

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\$1797 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.55%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 | 460,7 | 233,5 | 160,3 | 342,8 | 9,2 | 53,9 | 64 |
| 15-35 | 219,3 | 630,9 | 441,8 | 67,5 | 97,1 | 59,8 | 92 |
| 36-60 | 20,9 | 84,5 | 63,0 | 0,0 | 11,5 | 10,9 | 10 |
| 61-90 | 3,4 | 118,0 | 0,0 | 0,0 | 118,0 | 3,4 | 0 |
| 91-180 | 64,7 | 45,6 | 9,4 | 62,8 | 36,1 | 1,9 | 0 |
| >180 | 60,2 | 51,0 | 20,0 | 30,0 | 1,0 | 0,2 | 30 |
| Total | 829,3 | 1163,3 | 694,5 | 503,1 | 272,8 | 130,2 | 196 |

^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 | 5.34% | | 4.73% | 5.26% | 5.18% |
| 15-35 | 5.53% | | 5.87% | 5.25% | 5.71% |
| 36-60 | 5.50% | | 5.76% | 5.20% | 5.49% |
| 61-90 | - | | 5.50% | 5.30% | 5.49% |
| 91-180 | - | | 5.84% | 5.63% | 5.83% |
| >180 | 6.38% | | 6.31% | 6.17% | 6.29% |
| Total | 5.60% | | 5.66% | 5.32% | 5.55% |

^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

| Sector | 11 – 15 abr. | | | | 18 - 22 abr. | | | | 25 - 29 abr. | | | |
|--------------------------------------|--------------|------------|--------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 53 | 171 | 5312 | 5821 | 110 | 258 | 5513 | 5524 | 54 | 276 | 5233 | 5426 |
| Intragruppo y off-shore ^b | 1 | 0 | 3674 | 3287 | 10 | 0 | 2829 | 2516 | 0 | 0 | 2859 | 2675 |
| Otros ^c | 170 | 53 | 1018 | 865 | 248 | 110 | 1151 | 1319 | 276 | 54 | 938 | 860 |
| Total | 224 | 224 | 10004 | 9973 | 368 | 368 | 9493 | 9359 | 330 | 330 | 9030 | 8961 |

^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.