

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 08 de febrero de 2022
Fecha de Información: 04 de febrero 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\$1763 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.33%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 498,0 | 379,9 | 126,8 | 306,3 | 99,4 | 38,0 | 153,7 |
| 15-35 | 191,6 | 621,7 | 543,4 | 85,9 | 30,6 | 58,0 | 47,7 |
| 36-60 | 62,1 | 7,8 | 0,0 | 24,0 | 7,8 | 38,0 | 0,0 |
| 61-90 | 42,4 | 61,0 | 20,0 | 25,0 | 31,0 | 7,4 | 10,0 |
| 91-180 | 10,1 | 25,6 | 0,0 | 4,9 | 25,6 | 5,2 | 0,0 |
| >180 | 68,5 | 65,6 | 0,0 | 2,4 | 5,6 | 6,2 | 60,0 |
| Total | 872,6 | 1161,6 | 690,2 | 448,4 | 199,9 | 152,8 | 271,4 |

^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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 4.41% | | 11.29% | 4.19% | 6.01% |
| 15-35 | 4.75% | | 4.67% | 4.61% | 4.67% |
| 36-60 | — | | 4.83% | 4.68% | 4.71% |
| 61-90 | 4.92% | | 4.96% | 4.78% | 4.88% |
| 91-180 | — | | 5.19% | 4.91% | 5.14% |
| >180 | 5.52% | | 5.36% | 4.89% | 5.45% |
| Total | 4.73% | | 6.40% | 4.38% | 5.33% |

^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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 31 ene. - 04 feb. | | | | 07 - 11 feb. | | | | 14 - 18 feb. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 3 | 38 | 606 | 922 | 47 | 179 | 7549 | 8065 | 24 | 176 | 5463 | 6870 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 574 | 235 | 0 | 0 | 4230 | 3089 | 0 | 0 | 4396 | 2447 |
| Otros ^c | 38 | 3 | 90 | 108 | 179 | 47 | 911 | 1379 | 176 | 24 | 779 | 1229 |
| Total | 41 | 41 | 1270 | 1265 | 226 | 226 | 12690 | 12533 | 200 | 200 | 10638 | 10546 |

^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.