

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 17 de febrero de 2022
Fecha de Información: 15 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\$3770 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.02%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 922,6 | 533,0 | 424,2 | 774,7 | 4,6 | 43,7 | 104,2 |
| 15-35 | 1077,0 | 1304,3 | 778,3 | 473,7 | 59,0 | 136,4 | 467,0 |
| 36-60 | 20,5 | 227,6 | 212,4 | 5,0 | 7,1 | 7,5 | 8,1 |
| 61-90 | 43,6 | 75,6 | 29,6 | 20,0 | 26,0 | 3,6 | 20,0 |
| 91-180 | 35,4 | 38,1 | 10,0 | 32,4 | 26,5 | 1,4 | 1,6 |
| >180 | 75,0 | 21,3 | 15,0 | 60,0 | 3,3 | 12,0 | 3,0 |
| Total | 2174,2 | 2199,9 | 1469,4 | 1365,8 | 126,6 | 204,6 | 603,9 |

^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 | 4.55% | 4.42% | 2.99% | 3.56% |
| 15-35 | 4.53% | 3.48% | 4.46% | 4.02% |
| 36-60 | 4.47% | 4.84% | 4.38% | 4.55% |
| 61-90 | 5.19% | 5.24% | 5.12% | 5.19% |
| 91-180 | 5.36% | 5.77% | 5.51% | 5.62% |
| >180 | 6.14% | 6.38% | 6.26% | 6.28% |
| Total | 4.57% | 3.90% | 3.80% | 4.02% |

^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.

¹ A 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.

² El 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

| Sectores | 14 – 18 feb. | | | | 21 - 25 feb. | | | | 28 feb. - 04 mar. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 32 | 168 | 6632 | 7580 | 41 | 175 | 8853 | 8481 | 23 | 156 | 4188 | 5672 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 1 | 0 | 4615 | 3608 | 0 | 0 | 5100 | 4196 | 0 | 0 | 3611 | 1909 |
| Otros ^c | 167 | 32 | 1167 | 1129 | 175 | 41 | 906 | 2102 | 156 | 23 | 496 | 669 |
| Total | 200 | 200 | 12414 | 12317 | 216 | 216 | 14859 | 14779 | 179 | 179 | 8295 | 8250 |

^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.