

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de marzo de 2022
Fecha de Información: 01 de marzo 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\$2976 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.04%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragruppo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 854,2 | 704,8 | 279,6 | 470,2 | 237,2 | 196,1 | 188,0 |
| 15-35 | 521,5 | 575,7 | 408,8 | 376,4 | 36,7 | 14,8 | 130,3 |
| 36-60 | 88,5 | 105,3 | 1,2 | 0,0 | 104,1 | 88,5 | 0,0 |
| 61-90 | 23,7 | 52,9 | 20,0 | 9,1 | 32,9 | 14,6 | 0,0 |
| 91-180 | 198,8 | 131,9 | 10,0 | 168,0 | 91,9 | 0,8 | 30,0 |
| >180 | 31,5 | 35,6 | 10,0 | 30,0 | 25,6 | 1,5 | 0,0 |
| Total | 1718,3 | 1606,1 | 729,6 | 1053,7 | 528,3 | 316,3 | 348,3 |

^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 intragruppo | | Total |
|--------------|---|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 3.98% | 3.59% | 3.86% | 3.79% |
| 15-35 | 3.95% | 3.99% | 3.89% | 3.96% |
| 36-60 | — | 4.23% | 3.97% | 4.11% |
| 61-90 | — | 4.78% | 4.74% | 4.77% |
| 91-180 | 4.94% | 5.29% | 5.44% | 5.24% |
| >180 | — | 6.06% | 5.63% | 5.95% |
| Total | 4.05% | 4.12% | 3.95% | 4.04% |

^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 intragruppo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 28 feb. - 04 mar. | | | | 07 - 11 mar. | | | | 14 - 18 mar. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 24 | 106 | 5098 | 6000 | 75 | 163 | 6780 | 6998 | 22 | 214 | 6550 | 8133 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3908 | 2831 | 1 | 0 | 3895 | 3102 | 0 | 0 | 5304 | 2809 |
| Otros ^c | 106 | 24 | 590 | 716 | 163 | 75 | 1172 | 1392 | 214 | 22 | 1265 | 2071 |
| Total | 130 | 130 | 9596 | 9547 | 239 | 238 | 11847 | 11492 | 236 | 236 | 13119 | 13013 |

^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.