

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 04 de marzo de 2022
Fecha de Información: 02 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\$4083 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.43%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 | 612,5 | 453,0 | 195,0 | 398,2 | 53,0 | 9,3 | 205,0 |
| 15-35 | 722,9 | 915,8 | 625,7 | 579,6 | 154,3 | 7,5 | 135,8 |
| 36-60 | 4,0 | 194,3 | 137,4 | 1,5 | 56,9 | 2,5 | 0,0 |
| 61-90 | 216,1 | 108,2 | 6,0 | 211,7 | 102,2 | 4,4 | 0,0 |
| 91-180 | 505,7 | 450,7 | 25,0 | 239,3 | 160,7 | 1,4 | 265,0 |
| >180 | 364,1 | 162,0 | 90,0 | 271,3 | 51,8 | 72,6 | 20,1 |
| Total | 2425,3 | 2284,0 | 1079,2 | 1701,6 | 578,9 | 97,8 | 625,9 |

^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 | 4.11% | 4.01% | 3.24% | 3.67% |
| 15-35 | 3.77% | 4.13% | 4.29% | 4.14% |
| 36-60 | — | 4.51% | 4.16% | 4.50% |
| 61-90 | — | 4.72% | 4.48% | 4.66% |
| 91-180 | 4.92% | 5.42% | 4.93% | 5.08% |
| >180 | 5.65% | 6.01% | 5.68% | 5.81% |
| Total | 4.43% | 4.61% | 4.23% | 4.43% |

^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 | 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 | 27 | 92 | 4239 | 4780 | 75 | 176 | 6933 | 7220 | 21 | 229 | 6746 | 8349 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3124 | 2380 | 1 | 0 | 3951 | 3107 | 0 | 0 | 5405 | 2910 |
| Otros ^c | 92 | 27 | 500 | 653 | 176 | 75 | 1193 | 1395 | 229 | 21 | 1287 | 2074 |
| Total | 119 | 119 | 7863 | 7813 | 252 | 251 | 12077 | 11722 | 250 | 250 | 13438 | 13333 |

^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.