

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 01 de abril de 2022
Fecha de Información: 30 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\$1481 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.70%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 | 327,5 | 211,4 | 81,4 | 197,5 | 0 | 0 | 130 |
| 15-35 | 354,7 | 608,0 | 391,0 | 137,7 | 0 | 0 | 217 |
| 36-60 | 21,8 | 20,0 | 0,0 | 1,8 | 0 | 0 | 20 |
| 91-180 | 75,0 | 0,0 | 0,0 | 75,0 | 0 | 0 | 0 |
| >180 | 120,0 | 120,0 | 110,0 | 110,0 | 0 | 0 | 10 |
| Total | 899,0 | 959,4 | 582,4 | 522,0 | 0 | 0 | 377 |

^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 | 3.12% | 4.34% | 4.27% | 3.68% |
| 15-35 | 4.88% | 4.84% | 4.81% | 4.86% |
| 36-60 | 5.06% | — | — | 5.06% |
| 91-180 | — | — | 5.49% | 5.49% |
| >180 | 6.26% | 6.66% | 6.40% | 6.41% |
| Total | 4.32% | 4.82% | 5.21% | 4.70% |

^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 mar. - 01 abr. | | | | 04 - 08 abr. | | | | 11 - 15 abr. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 37 | 141 | 4839 | 5194 | 36 | 213 | 6328 | 6844 | 17 | 165 | 3686 | 4407 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2931 | 2563 | 0 | 0 | 4558 | 3386 | 1 | 0 | 3090 | 2061 |
| Otros ^c | 141 | 37 | 806 | 777 | 213 | 36 | 617 | 1210 | 164 | 17 | 487 | 775 |
| Total | 178 | 178 | 8576 | 8534 | 249 | 249 | 11503 | 11440 | 182 | 182 | 7263 | 7243 |

^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.