

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de abril de 2022
Fecha de Información: 12 de abril 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\$3272 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.51%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 | 471,2 | 364,3 | 241,5 | 390,7 | 64,1 | 21,8 | 58,7 |
| 15-35 | 661,4 | 1104,0 | 895,5 | 429,9 | 25,5 | 48,5 | 183,0 |
| 36-60 | 8,4 | 22,4 | 8,2 | 0,0 | 13,0 | 7,2 | 1,2 |
| 61-90 | 200,1 | 277,3 | 270,1 | 180,1 | 7,1 | 20,0 | 0,0 |
| 91-180 | 210,2 | 282,5 | 40,0 | 5,0 | 42,5 | 5,2 | 200,0 |
| >180 | 96,6 | 106,8 | 2,0 | 2,2 | 14,8 | 4,4 | 90,0 |
| Total | 1647,9 | 2157,3 | 1457,4 | 1007,8 | 167,0 | 107,2 | 532,9 |

^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 | 5.60% | 5.67% | 4.16% | 4.86% |
| 15-35 | 5.64% | 5.63% | 5.35% | 5.59% |
| 36-60 | 5.71% | 5.67% | 5.46% | 5.62% |
| 61-90 | — | 5.75% | 5.55% | 5.56% |
| 91-180 | 5.62% | 6.06% | 5.68% | 5.70% |
| >180 | 6.40% | 6.32% | 5.85% | 6.36% |
| Total | 5.76% | 5.67% | 5.01% | 5.51% |

^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 | 11 – 15 abr. | | | | 18 - 22 abr. | | | | 25 - 29 abr. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 31 | 107 | 4612 | 4865 | 112 | 258 | 5750 | 5813 | 60 | 277 | 5435 | 5614 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 1 | 0 | 3350 | 3209 | 10 | 0 | 2978 | 2660 | 0 | 0 | 2994 | 2822 |
| Otros ^c | 106 | 31 | 561 | 411 | 248 | 112 | 1214 | 1334 | 277 | 60 | 949 | 867 |
| Total | 138 | 138 | 8523 | 8485 | 370 | 370 | 9942 | 9807 | 337 | 337 | 9378 | 9303 |

^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.