

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 19 de abril de 2022
Fecha de Información: 13 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\$2623 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.50%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 | 699,2 | 481,8 | 351,4 | 573,0 | 21,3 | 17,3 | 109,0 |
| 15-35 | 545,0 | 891,3 | 676,3 | 350,7 | 23,2 | 2,5 | 191,8 |
| 36-60 | 1,8 | 31,0 | 17,9 | 0,0 | 13,1 | 1,8 | 0,0 |
| 61-90 | 142,9 | 43,8 | 27,1 | 140,0 | 16,7 | 2,9 | 0,0 |
| 91-180 | 36,7 | 35,4 | 13,0 | 30,0 | 22,4 | 6,7 | 0,0 |
| >180 | 0,0 | 14,5 | 10,0 | 0,0 | 4,5 | 0,0 | 0,0 |
| Total | 1425,7 | 1497,8 | 1095,8 | 1093,7 | 101,3 | 31,2 | 300,8 |

^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 | 5.65% | 4.74% | 3.53% | 4.10% |
| 15-35 | 5.62% | 4.43% | 4.98% | 4.75% |
| 36-60 | — | 5.71% | 5.43% | 5.67% |
| 61-90 | — | 5.80% | 4.08% | 4.29% |
| 91-180 | — | 5.99% | 5.62% | 5.79% |
| >180 | — | 6.20% | 5.21% | 6.19% |
| Total | 5.63% | 4.63% | 4.02% | 4.50% |

^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 | 13 | 59 | 694 | 710 | 113 | 263 | 6128 | 5995 | 61 | 274 | 5624 | 5775 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 1 | 0 | 389 | 407 | 10 | 0 | 3110 | 2984 | 0 | 0 | 3085 | 2947 |
| Otros ^c | 58 | 13 | 108 | 58 | 253 | 113 | 1222 | 1347 | 274 | 61 | 969 | 871 |
| Total | 72 | 72 | 1191 | 1175 | 376 | 376 | 10460 | 10326 | 335 | 335 | 9678 | 9593 |

^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.