

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 22 de abril de 2022
Fecha de Información: 20 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\$2937 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.36%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 | 541,6 | 548,2 | 166,7 | 318,0 | 222,3 | 64,4 | 159,2 |
| 15-35 | 735,2 | 943,3 | 492,5 | 281,5 | 58,7 | 61,6 | 392,1 |
| 36-60 | 181,6 | 59,2 | 0,0 | 32,6 | 19,2 | 109,0 | 40,0 |
| 61-90 | 31,5 | 32,8 | 0,0 | 10,0 | 12,8 | 1,5 | 20,0 |
| 91-180 | 151,4 | 59,7 | 20,0 | 0,0 | 14,5 | 126,3 | 25,1 |
| >180 | 179,3 | 235,0 | 90,0 | 50,1 | 20,0 | 4,2 | 125,0 |
| Total | 1820,6 | 1878,2 | 769,3 | 692,2 | 347,5 | 367,0 | 761,4 |

^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 | 5.59% | 5.63% | 3.98% | 4.91% |
| 15-35 | 5.62% | 5.39% | 5.53% | 5.50% |
| 36-60 | 5.63% | 5.65% | 5.51% | 5.55% |
| 61-90 | 5.64% | 5.73% | 5.44% | 5.67% |
| 91-180 | 5.78% | 5.99% | 5.57% | 5.64% |
| >180 | 6.16% | 6.36% | 5.82% | 6.18% |
| Total | 5.71% | 5.52% | 4.87% | 5.36% |

^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 | 18 – 22 abr. | | | | 25 - 29 abr. | | | | 02 - 06 may. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 57 | 166 | 5301 | 5300 | 68 | 283 | 5771 | 6187 | 20 | 145 | 7251 | 7445 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 10 | 0 | 2927 | 2680 | 0 | 0 | 3220 | 2988 | 1 | 0 | 4212 | 3239 |
| Otros ^c | 156 | 57 | 826 | 960 | 283 | 68 | 1169 | 894 | 144 | 20 | 632 | 1341 |
| Total | 223 | 223 | 9054 | 8940 | 351 | 351 | 10160 | 10069 | 165 | 165 | 12095 | 12025 |

^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.