

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 16 de julio de 2021
Fecha de Información: 14 de julio de 2021¹

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\$2037 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.96%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 | 599,6 | 414,1 | 162,9 | 338,8 | 112,4 | 122,1 | 138,8 |
| 15-35 | 481,4 | 746,4 | 375,7 | 99,9 | 23,3 | 34,0 | 347,5 |
| 36-60 | 31,4 | 16,0 | 2,5 | 0,0 | 8,5 | 26,4 | 5,0 |
| 61-90 | 77,6 | 83,3 | 0,8 | 4,0 | 51,6 | 42,7 | 30,9 |
| 91-180 | 33,5 | 48,2 | 0,0 | 0,0 | 28,2 | 13,5 | 20,0 |
| >180 | 34,2 | 39,6 | 12,6 | 0,0 | 1,0 | 8,2 | 26,0 |
| Total | 1257,7 | 1347,7 | 554,5 | 442,6 | 225,0 | 246,9 | 568,2 |

^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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 1.94% | | 2.04% | 1.76% | 1.87% |
| 15-35 | 1.97% | | 1.98% | 1.89% | 1.97% |
| 36-60 | 1.89% | | 2.23% | 1.91% | 1.98% |
| 61-90 | 1.95% | | 2.15% | 1.92% | 2.02% |
| 91-180 | 1.93% | | 2.21% | 1.86% | 2.05% |
| >180 | 2.77% | | 3.35% | 2.35% | 2.85% |
| Total | 2.00% | | 2.06% | 1.81% | 1.96% |

^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 | 12 – 16 jul. | | | | 19 - 23 jul. | | | | 26 - 30 jul. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 52 | 134 | 5403 | 5428 | 54 | 130 | 3474 | 3690 | 42 | 252 | 7056 | 8099 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 2 | 2377 | 1808 | 0 | 2 | 2180 | 1563 | 7 | 2 | 4773 | 2824 |
| Otros ^c | 134 | 50 | 1715 | 2234 | 130 | 52 | 692 | 1079 | 245 | 40 | 1143 | 1995 |
| Total | 186 | 186 | 9495 | 9470 | 184 | 184 | 6346 | 6332 | 294 | 294 | 12972 | 12918 |

^a Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.