

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 26 de agosto de 2021
Fecha de Información: 24 de agosto 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\$2881 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.26%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 | 612,5 | 631,9 | 165,7 | 420,2 | 306,6 | 32,7 | 159,6 |
| 15-35 | 593,9 | 520,6 | 398,0 | 490,1 | 38,0 | 19,1 | 84,6 |
| 36-60 | 8,8 | 82,1 | 50,0 | 5,0 | 32,1 | 3,8 | 0,0 |
| 61-90 | 14,2 | 12,4 | 0,0 | 0,0 | 10,1 | 12,0 | 2,2 |
| 91-180 | 2,9 | 18,8 | 10,0 | 0,0 | 8,8 | 2,9 | 0,0 |
| >180 | 315,4 | 325,8 | 307,0 | 10,0 | 7,2 | 293,8 | 11,5 |
| Total | 1547,6 | 1591,6 | 930,8 | 925,3 | 402,8 | 364,3 | 258,0 |

^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 | 2.56% | 2.13% | 2.00% | 2.15% |
| 15-35 | 2.21% | 2.23% | 2.21% | 2.22% |
| 36-60 | — | 2.37% | 1.76% | 2.30% |
| 61-90 | 2.22% | 2.41% | 2.12% | 2.25% |
| 91-180 | — | 2.39% | 2.07% | 2.35% |
| >180 | 2.41% | 2.43% | 2.62% | 2.54% |
| Total | 2.43% | 2.24% | 2.25% | 2.26% |

^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 | 23 – 27 ago. | | | | 30 ago. - 03 sept. | | | | 06 - 10 sept. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------------|------------|-------------|-------------|---------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 50 | 149 | 5944 | 5925 | 25 | 183 | 3797 | 4685 | 24 | 103 | 3653 | 4452 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2797 | 2008 | 0 | 0 | 2951 | 1828 | 0 | 0 | 2665 | 1423 |
| Otros ^c | 149 | 50 | 1483 | 2283 | 183 | 25 | 731 | 931 | 103 | 24 | 754 | 725 |
| Total | 199 | 199 | 10224 | 10216 | 208 | 208 | 7479 | 7444 | 127 | 127 | 7072 | 6600 |

^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.