

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2021
Fecha de Información: 10 de septiembre 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\$1878 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.14%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 | 185,6 | 396,1 | 228,5 | 94,9 | 115,1 | 38,1 | 52,5 |
| 15-35 | 478,9 | 402,5 | 227,0 | 274,3 | 29,0 | 58,1 | 146,5 |
| 36-60 | 63,0 | 39,9 | 0,0 | 0,0 | 39,9 | 63,0 | 0,0 |
| 61-90 | 17,6 | 5,4 | 1,9 | 15,0 | 3,5 | 2,6 | 0,0 |
| 91-180 | 197,6 | 247,6 | 203,9 | 145,0 | 33,7 | 42,6 | 10,0 |
| >180 | 31,4 | 31,8 | 20,0 | 1,7 | 1,8 | 19,7 | 10,0 |
| Total | 974,0 | 1123,2 | 681,3 | 530,9 | 222,9 | 224,1 | 219,0 |

^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 | 2.11% | 1.85% | 1.99% | 1.93% |
| 15-35 | 2.15% | 2.24% | 2.01% | 2.12% |
| 36-60 | — | 2.32% | 2.02% | 2.14% |
| 61-90 | — | 2.47% | 1.34% | 1.69% |
| 91-180 | 2.26% | 2.32% | 2.21% | 2.28% |
| >180 | 2.58% | 3.01% | 4.83% | 4.05% |
| Total | 2.17% | 2.11% | 2.17% | 2.14% |

^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 | 06 – 10 sep. | | | | 13 - 17 sep. | | | | 20 - 24 sep. | | | |
|-------------------------------------|--------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 13 | 32 | 650 | 690 | 45 | 160 | 7219 | 8126 | 24 | 127 | 4918 | 6008 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 82 | 65 | 0 | 0 | 4459 | 3198 | 0 | 0 | 2823 | 2390 |
| Otros ^c | 32 | 13 | 530 | 508 | 160 | 45 | 1733 | 2047 | 127 | 24 | 1813 | 1136 |
| Total | 45 | 45 | 1262 | 1263 | 205 | 205 | 13411 | 13371 | 151 | 151 | 9554 | 9534 |

^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.