

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 05 de noviembre de 2021
Fecha de Información: 03 de noviembre 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\$2374 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.99%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 | 223,8 | 465,8 | 312,5 | 106,0 | 111,3 | 75,8 | 42,0 |
| 15-35 | 457,1 | 983,8 | 598,8 | 125,7 | 130,6 | 77,0 | 254,5 |
| 36-60 | 26,1 | 5,3 | 0,0 | 1,5 | 3,3 | 22,6 | 2,0 |
| 61-90 | 252,2 | 21,3 | 0,0 | 10,0 | 6,3 | 227,2 | 15,0 |
| 91-180 | 135,7 | 57,2 | 15,0 | 90,5 | 26,2 | 29,3 | 16,0 |
| >180 | 74,1 | 26,2 | 0,0 | 36,2 | 1,2 | 12,9 | 25,0 |
| Total | 1169,1 | 1559,5 | 926,2 | 369,8 | 278,9 | 444,8 | 354,5 |

^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 | 3.04% | | 2.82% | 2.88% | 2.86% |
| 15-35 | 3.11% | | 3.09% | 2.93% | 3.07% |
| 36-60 | 2.89% | | 3.10% | 2.67% | 2.74% |
| 61-90 | 2.86% | | 3.02% | 2.85% | 2.86% |
| 91-180 | 2.91% | | 3.09% | 2.86% | 2.92% |
| >180 | 3.30% | | 4.04% | 3.26% | 3.28% |
| Total | 3.09% | | 3.02% | 2.90% | 2.99% |

^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.

¹A 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.

²El 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 01 – 05 nov. | | | | 08 - 12 nov. | | | | 15 - 19 nov. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 80 | 89 | 3848 | 4167 | 69 | 158 | 3749 | 4200 | 27 | 152 | 4089 | 4225 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2622 | 1920 | 0 | 0 | 2191 | 1316 | 0 | 0 | 1864 | 1259 |
| Otros ^c | 89 | 80 | 381 | 714 | 158 | 69 | 733 | 1055 | 152 | 27 | 844 | 1226 |
| Total | 169 | 169 | 6851 | 6801 | 227 | 227 | 6673 | 6571 | 179 | 179 | 6797 | 6710 |

^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.