

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2021

Fecha de Información: 16 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\$3118 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.53%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 322,2 | 371,6 | 211,9 | 108,6 | 99,8 | 153,6 | 60,0 |
| 15-35 | 718,4 | 1165,8 | 730,6 | 206,9 | 36,2 | 112,6 | 399,0 |
| 36-60 | 54,3 | 248,1 | 219,2 | 10,0 | 3,9 | 19,3 | 25,0 |
| 61-90 | 210,4 | 8,2 | 0,0 | 200,0 | 8,2 | 10,4 | 0,0 |
| 91-180 | 263,7 | 245,0 | 88,5 | 54,0 | 51,5 | 104,7 | 105,0 |
| >180 | 66,6 | 47,9 | 25,0 | 45,1 | 7,8 | 6,4 | 15,1 |
| Total | 1635,6 | 2086,7 | 1275,2 | 624,5 | 207,3 | 407,0 | 604,1 |

^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 | 3.58% | 3.66% | 3.42% | 3.55% |
| 15-35 | 3.54% | 3.69% | 3.48% | 3.60% |
| 36-60 | 3.42% | 3.34% | 3.04% | 3.23% |
| 61-90 | — | 3.24% | 2.97% | 3.09% |
| 91-180 | 3.27% | 3.30% | 3.15% | 3.23% |
| >180 | 4.08% | 3.55% | 3.56% | 3.72% |
| Total | 3.51% | 3.65% | 3.37% | 3.53% |

^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 | 15 – 19 nov. | | | | 22 - 26 nov. | | | | 29 nov. - 03 dic. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 55 | 160 | 6239 | 6079 | 181 | 228 | 4390 | 6041 | 29 | 165 | 3695 | 4812 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2406 | 2179 | 0 | 0 | 3197 | 1182 | 0 | 0 | 2600 | 925 |
| Otros ^c | 160 | 55 | 1279 | 1578 | 228 | 181 | 1124 | 1419 | 165 | 29 | 589 | 1101 |
| Total | 215 | 215 | 9924 | 9836 | 409 | 409 | 8711 | 8642 | 194 | 194 | 6884 | 6838 |

^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.