

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 02 de diciembre de 2021

Fecha de Información: 30 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\$2752 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.38%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 | 581,7 | 321,6 | 240,0 | 509,0 | 13,1 | 4,2 | 68,5 |
| 15-35 | 638,6 | 685,7 | 514,1 | 438,4 | 23,0 | 51,7 | 148,5 |
| 36-60 | 119,7 | 79,8 | 0,0 | 0,0 | 69,8 | 109,7 | 10,0 |
| 61-90 | 213,2 | 196,2 | 127,0 | 138,0 | 29,2 | 35,2 | 40,0 |
| 91-180 | 37,1 | 51,2 | 30,0 | 30,0 | 21,2 | 7,1 | 0,0 |
| >180 | 92,3 | 78,9 | 0,0 | 0,0 | 2,4 | 15,8 | 76,5 |
| Total | 1682,5 | 1413,5 | 911,1 | 1115,4 | 158,8 | 223,5 | 343,5 |

^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 | | Total |
|--------------|---|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 4.88% | 4.70% | 3.97% | 4.28% |
| 15-35 | 4.84% | 4.60% | — | 4.64% |
| 36-60 | 4.49% | 4.28% | 4.54% | 4.45% |
| 61-90 | 3.97% | 4.08% | 3.83% | 3.92% |
| 91-180 | — | 3.83% | 3.76% | 3.80% |
| >180 | 4.18% | 4.23% | 3.79% | 4.11% |
| Total | 4.59% | 4.51% | 4.21% | 4.38% |

^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 | 29 nov. - 03 dic. | | | | 06 - 10 dic. | | | | 13 - 17 dic. | | | |
|-------------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 44 | 105 | 4652 | 5502 | 80 | 113 | 3403 | 4785 | 60 | 151 | 6581 | 10524 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 3189 | 1880 | 0 | 0 | 2828 | 732 | 0 | 0 | 7239 | 2349 |
| Otros ^c | 105 | 44 | 512 | 908 | 113 | 80 | 465 | 651 | 151 | 60 | 1323 | 2227 |
| Total | 149 | 149 | 8353 | 8290 | 193 | 193 | 6696 | 6168 | 211 | 211 | 15143 | 15100 |

^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.