

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 03 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 01 de diciembre 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\$3570 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.31%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 | 795,4 | 283,6 | 208,8 | 702,2 | 14,5 | 32,9 | 60,2 |
| 15-35 | 543,7 | 1158,8 | 876,2 | 288,6 | 35,6 | 8,2 | 247,0 |
| 36-60 | 165,1 | 71,2 | 0,5 | 0,0 | 27,3 | 121,6 | 43,5 |
| 61-90 | 215,9 | 190,5 | 134,0 | 130,0 | 38,5 | 67,9 | 18,0 |
| 91-180 | 43,9 | 75,3 | 57,0 | 42,8 | 18,3 | 1,1 | 0,0 |
| >180 | 215,9 | 204,8 | 95,0 | 183,4 | 84,4 | 7,1 | 25,4 |
| Total | 1979,9 | 1984,2 | 1371,5 | 1347,0 | 218,6 | 238,8 | 394,1 |

^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 | | |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 4.43% | | 4.40% | 3.57% | 3.81% |
| 15-35 | 4.26% | | 4.01% | 4.37% | 4.12% |
| 36-60 | 4.45% | | 4.18% | 3.66% | 3.91% |
| 61-90 | 3.51% | | 12.19% | 3.62% | 7.72% |
| 91-180 | — | | 3.67% | 3.71% | 3.68% |
| >180 | 3.85% | | 3.92% | 3.34% | 3.65% |
| Total | 4.25% | | 4.96% | 3.68% | 4.31% |

^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 | 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 | 40 | 63 | 3968 | 4335 | 80 | 124 | 3541 | 4912 | 60 | 154 | 6792 | 10741 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 2617 | 1882 | 0 | 0 | 2924 | 830 | 0 | 0 | 7363 | 2445 |
| Otros ^c | 63 | 40 | 280 | 624 | 124 | 80 | 463 | 656 | 154 | 60 | 1329 | 2255 |
| Total | 103 | 103 | 6865 | 6841 | 204 | 204 | 6928 | 6398 | 214 | 214 | 15484 | 15441 |

^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.