

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 23 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\$1686 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.98%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 | 380,3 | 70,2 | 18,4 | 325,3 | 5,8 | 9,0 | 46,0 |
| 15-35 | 411,3 | 782,5 | 462,6 | 54,5 | 15,4 | 52,3 | 304,5 |
| 36-60 | 103,8 | 113,6 | 0,0 | 0,0 | 11,6 | 1,8 | 102,0 |
| 61-90 | 165,8 | 143,4 | 25,0 | 25,0 | 6,4 | 28,8 | 112,0 |
| 91-180 | 56,1 | 16,8 | 0,0 | 45,0 | 6,8 | 1,1 | 10,0 |
| >180 | 7,2 | 10,0 | 0,0 | 0,0 | 10,0 | 7,2 | 0,0 |
| Total | 1124,5 | 1136,5 | 506,0 | 449,8 | 56,0 | 100,2 | 574,5 |

^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 | 4.18% | | 4.47% | 3.33% | 3.50% |
| 15-35 | 4.24% | | 4.06% | 4.24% | 4.15% |
| 36-60 | 4.06% | | 4.00% | 4.12% | 4.06% |
| 61-90 | 4.08% | | 3.93% | 4.08% | 4.06% |
| 91-180 | 4.15% | | 4.17% | 4.13% | 4.14% |
| >180 | — | | 4.61% | 4.80% | 4.69% |
| Total | 4.17% | | 4.09% | 3.64% | 3.98% |

^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 | 20 – 24 dic. | | | | 27 - 31 dic. | | | | 03 - 07 ene. | | | |
|-------------------------------------|--------------|-----------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 7 | 53 | 940 | 1179 | 32 | 120 | 4680 | 5914 | 25 | 85 | 3268 | 5073 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 800 | 565 | 0 | 10 | 4554 | 3275 | 0 | 0 | 3804 | 1948 |
| Otros ^c | 53 | 7 | 54 | 41 | 120 | 22 | 332 | 330 | 85 | 25 | 217 | 187 |
| Total | 60 | 60 | 1794 | 1785 | 152 | 152 | 9566 | 9519 | 110 | 110 | 7289 | 7208 |

^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.