

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 29 de diciembre de 2021
Fecha de Información: 27 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\$1585 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.01%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 | 395,5 | 260,7 | 138,7 | 274,0 | 11,5 | 11,0 | 110,5 |
| 15-35 | 570,5 | 707,6 | 327,6 | 192,7 | 24,5 | 22,3 | 355,5 |
| 36-60 | 14,6 | 19,3 | 5,0 | 0,0 | 4,3 | 4,6 | 10,0 |
| 61-90 | 32,8 | 14,1 | 4,8 | 21,7 | 9,3 | 11,1 | 0,0 |
| 91-180 | 15,7 | 28,7 | 0,0 | 15,0 | 28,7 | 0,7 | 0,0 |
| >180 | 0,4 | 1,0 | 0,0 | 0,0 | 1,0 | 0,4 | 0,0 |
| Total | 1029,4 | 1031,4 | 476,1 | 503,4 | 79,4 | 50,0 | 476,0 |

^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 | 4.26% | | 2.33% | 4.19% | 3.91% |
| 15-35 | 4.10% | | 3.92% | 4.07% | 4.04% |
| 36-60 | 4.12% | | 4.37% | 3.87% | 4.17% |
| 61-90 | — | | 4.19% | 3.94% | 4.05% |
| 91-180 | — | | 4.11% | 4.50% | 4.25% |
| >180 | — | | 4.98% | 4.51% | 4.86% |
| Total | 4.14% | | 3.69% | 4.16% | 4.01% |

^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 | 27 – 31 dic. | | | | 03 - 07 ene. | | | | 10 - 14 ene. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|--------------|--------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 31 | 145 | 5149 | 6214 | 27 | 82 | 3425 | 5223 | 50 | 110 | 4953 | 6818 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 10 | 4718 | 3608 | 0 | 0 | 3893 | 2021 | 0 | 0 | 4710 | 2041 |
| Otros ^c | 145 | 21 | 343 | 330 | 82 | 27 | 230 | 223 | 110 | 50 | 637 | 1279 |
| Total | 176 | 176 | 10210 | 10152 | 109 | 109 | 7548 | 7467 | 160 | 160 | 10300 | 10138 |

^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.