

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 09 de julio de 2021
Fecha de Información: 07 de julio 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\$2147 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.95%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragruppo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 430,3 | 352,8 | 169,8 | 190,3 | 70,0 | 127,0 | 113,0 |
| 15-35 | 570,4 | 724,0 | 484,7 | 354,6 | 78,2 | 54,6 | 161,1 |
| 36-60 | 12,7 | 25,7 | 1,4 | 0,0 | 24,3 | 12,7 | 0,0 |
| 61-90 | 31,3 | 20,0 | 0,8 | 0,1 | 19,2 | 31,2 | 0,0 |
| 91-180 | 48,6 | 176,2 | 135,0 | 0,1 | 1,2 | 8,5 | 40,0 |
| >180 | 18,9 | 55,2 | 35,3 | 0,6 | 14,8 | 13,3 | 5,0 |
| Total | 1112,1 | 1353,9 | 827,0 | 545,6 | 207,7 | 247,3 | 319,1 |

^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 | 1.95% | | 1.79% | 1.86% | 1.86% |
| 15-35 | 1.97% | | 2.04% | 1.87% | 1.98% |
| 36-60 | - | | 2.04% | 1.74% | 1.94% |
| 61-90 | - | | 2.16% | 1.85% | 1.97% |
| 91-180 | 2.00% | | 2.47% | 1.72% | 1.97% |
| >180 | 3.00% | | 2.74% | 2.37% | 2.66% |
| Total | 1.98% | | 2.00% | 1.87% | 1.95% |

^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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 05 – 09 jul. | | | | 12 - 16 jul. | | | | 19 - 23 jul. | | | |
|-------------------------------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 34 | 107 | 2940 | 3047 | 56 | 135 | 5110 | 5950 | 47 | 126 | 3120 | 3081 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 1968 | 1673 | 0 | 2 | 2960 | 1724 | 0 | 2 | 1899 | 1360 |
| Otros ^c | 107 | 34 | 419 | 571 | 135 | 54 | 1612 | 1988 | 126 | 45 | 503 | 1068 |
| Total | 141 | 141 | 5327 | 5291 | 191 | 191 | 9682 | 9662 | 173 | 173 | 5522 | 5509 |

^a Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.