

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 02 de julio de 2021**  
**Fecha de Información: 30 de junio de 2021<sup>1</sup>**

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\$2251 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.96%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	621,5	400,9	196,1	394,2	52,9	75,3	152,0
15-35	559,1	593,9	392,1	298,1	32,5	91,7	169,3
36-60	9,0	6,1	0,0	0,0	6,1	9,0	0,0
61-90	153,7	24,0	0,0	15,0	24,0	138,7	0,0
91-180	20,8	154,1	145,0	10,3	9,1	10,5	0,0
>180	6,4	24,8	13,0	0,0	9,8	4,4	2,0
<b>Total</b>	<b>1370,4</b>	<b>1203,8</b>	<b>746,2</b>	<b>717,6</b>	<b>134,4</b>	<b>329,5</b>	<b>323,3</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

<sup>c</sup> 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 <sup>a</sup>		Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.96%		2.02%	1.91%	1.95%
15-35	1.95%		1.96%	1.86%	1.93%
36-60	-		2.12%	1.82%	1.94%
61-90	-		2.13%	1.94%	1.96%
91-180	-		2.11%	1.97%	2.10%
>180	2.89%		2.78%	2.36%	2.72%
<b>Total</b>	<b>1.96%</b>		<b>2.03%</b>	<b>1.90%</b>	<b>1.96%</b>

<sup>a</sup> 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.

<sup>1</sup>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.

<sup>2</sup>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	28 jun. - 02 jul.				05 - 09 jul.				12 - 16 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	57	101	3277	3184	35	117	3543	3711	85	255	7583	8389
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1768	1955	0	0	2351	1905	0	2	4555	2730
Otros <sup>c</sup>	101	57	523	392	117	35	482	721	255	83	1996	2986
<b>Total</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>5568</b>	<b>5531</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>6376</b>	<b>6337</b>	<b>340</b>	<b>340</b>	<b>14134</b>	<b>14105</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

<sup>b</sup> Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

<sup>c</sup> Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.