

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de julio de 2021**  
**Fecha de Información: 09 de julio 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\$2874 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.97%<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	539,5	568,6	112,9	220,0	351,7	215,4	104,0
15-35	440,7	718,8	454,8	130,9	12,2	58,0	251,8
36-60	96,0	233,3	0,0	30,0	233,3	66,0	0,0
61-90	62,0	67,8	55,2	46,1	12,6	15,9	0,0
91-180	347,2	75,8	20,7	10,0	5,1	287,2	50,0
>180	100,8	39,8	21,0	70,2	8,2	20,0	10,6
<b>Total</b>	<b>1586,2</b>	<b>1704,0</b>	<b>664,5</b>	<b>507,2</b>	<b>623,0</b>	<b>662,5</b>	<b>416,4</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	1.93%		1.74%	1.96%	1.86%
15-35	2.01%		2.03%	1.95%	2.01%
36-60	-		2.03%	1.98%	2.02%
61-90	-		2.20%	2.03%	2.07%
91-180	2.00%		2.09%	1.97%	1.98%
>180	3.34%		2.75%	2.67%	2.83%
<b>Total</b>	<b>2.02%</b>		<b>1.94%</b>	<b>1.98%</b>	<b>1.97%</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	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 <sup>a</sup>	9	44	607	654	65	147	5789	6611	48	127	3237	3202
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	356	159	0	2	3127	2045	0	2	1982	1450
Otros <sup>c</sup>	44	9	151	301	147	63	1973	2209	127	46	519	1072
<b>Total</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>1114</b>	<b>1114</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>10889</b>	<b>10865</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>5738</b>	<b>5724</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.