

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de julio de 2021**  
**Fecha de Información: 26 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\$2239 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.89%<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	367,4	547,1	48,0	222,9	416,1	61,5	83,0
15-35	386,2	696,2	415,0	122,7	46,7	28,9	234,5
36-60	45,7	25,8	0,0	10,0	15,8	25,7	10,0
61-90	361,7	4,6	0,0	0,0	4,6	361,7	0,0
91-180	29,0	52,6	40,0	1,1	2,6	17,9	10,0
>180	58,6	27,7	1,8	0,0	0,1	32,8	25,8
<b>Total</b>	<b>1248,6</b>	<b>1353,9</b>	<b>504,8</b>	<b>356,7</b>	<b>485,9</b>	<b>528,6</b>	<b>363,3</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	1.92%		1.93%	1.73%	1.86%
15-35	1.90%		1.93%	1.81%	1.90%
36-60	1.96%		2.03%	1.80%	1.90%
61-90	-		2.12%	1.83%	1.84%
91-180	1.92%		1.93%	1.73%	1.88%
>180	2.33%		2.77%	2.44%	2.41%
<b>Total</b>	<b>1.94%</b>		<b>1.94%</b>	<b>1.82%</b>	<b>1.89%</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	26 – 30 jul.				02 - 06 ago.				09 - 13 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	62	186	5126	6302	20	95	4061	4518	51	122	3464	3996
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	4	2	3421	2260	3	0	2372	1527	0	0	2271	1329
Otros <sup>c</sup>	182	60	1529	1476	92	20	488	844	122	51	484	841
<b>Total</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>10076</b>	<b>10038</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>6921</b>	<b>6889</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>6219</b>	<b>6166</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.