

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de agosto de 2021**  
**Fecha de Información: 03 de agosto 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\$2372 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.76%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupa y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	445,4	188,7	84,7	272,5	18,0	87,0	86,0
15-35	425,8	1118,1	577,5	150,8	291,5	25,9	249,2
36-60	247,4	163,2	82,0	72,7	21,2	114,7	60,0
61-90	78,9	33,8	0,0	4,2	33,8	74,7	0,0
91-180	34,1	37,9	20,0	0,0	2,9	19,1	15,0
>180	6,9	2,2	0,8	0,0	1,3	6,9	0,0
<b>Total</b>	<b>1238,5</b>	<b>1543,9</b>	<b>765,1</b>	<b>500,2</b>	<b>368,7</b>	<b>328,2</b>	<b>410,2</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	1.84%		1.84%	1.27%	1.44%
15-35	1.91%		1.86%	1.81%	1.86%
36-60	1.89%		1.92%	1.79%	1.85%
61-90	-		2.02%	1.75%	1.83%
91-180	2.06%		1.98%	1.94%	1.99%
>180	-		2.60%	2.11%	2.19%
<b>Total</b>	<b>1.90%</b>		<b>1.87%</b>	<b>1.54%</b>	<b>1.76%</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	02 – 06 ago.				09 - 13 ago.				16 - 20 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	32	125	4458	4773	61	134	4015	4597	24	138	3658	3917
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	3	0	2539	2028	0	0	2597	1669	0	0	1878	1328
Otros <sup>c</sup>	122	32	580	744	134	61	626	909	138	24	1035	1319
<b>Total</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>7577</b>	<b>7545</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>7238</b>	<b>7175</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>6571</b>	<b>6564</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.