

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de julio de 2021**  
**Fecha de Información: 15 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\$2310 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.84%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	464,5	239,5	175,8	387,6	10,1	23,3	53,5
15-35	596,4	583,5	440,2	412,6	20,7	61,2	122,6
36-60	27,6	28,7	4,6	0,0	24,1	27,6	0,0
61-90	95,0	170,7	129,1	48,7	21,6	26,3	20,0
91-180	79,7	90,0	80,0	50,0	10,0	29,7	0,0
>180	33,2	122,4	96,3	0,0	0,6	7,7	25,5
<b>Total</b>	<b>1296,3</b>	<b>1234,8</b>	<b>926,0</b>	<b>898,9</b>	<b>87,2</b>	<b>175,8</b>	<b>221,6</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.77%		1.35%	1.84%	1.70%
15-35	1.94%		1.87%	1.90%	1.89%
36-60	–		2.02%	1.84%	1.92%
61-90	1.88%		1.95%	1.77%	1.89%
91-180	–		2.31%	1.89%	1.99%
>180	2.36%		2.58%	2.50%	2.46%
<b>Total</b>	<b>1.94%</b>		<b>1.77%</b>	<b>1.87%</b>	<b>1.84%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	12 - 16 jul.				19 - 23 jul.				26 - 30 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	21	100	4182	4246	57	133	3722	3743	32	160	4045	4738
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1863	1483	0	2	2220	1804	4	2	2814	1672
Otros <sup>c</sup>	100	21	1499	1805	133	55	701	1083	156	30	832	1243
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>7544</b>	<b>7534</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>6643</b>	<b>6630</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>7691</b>	<b>7653</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.