

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de julio de 2021**  
**Fecha de Información: 23 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\$1594 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.70%<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	621,6	530,8	175,4	262,0	81,4	85,6	274
15-35	268,2	286,8	204,2	154,4	19,6	50,9	63
36-60	6,2	6,5	3,2	0,0	3,2	6,2	0
61-90	27,2	60,8	23,6	0,0	37,2	27,2	0
91-180	50,5	30,1	0,2	0,4	14,9	35,0	15
>180	32,6	28,9	20,0	20,2	4,9	8,4	4
<b>Total</b>	<b>1006,3</b>	<b>943,9</b>	<b>426,6</b>	<b>437,0</b>	<b>161,2</b>	<b>213,3</b>	<b>356</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	1.88%		1.74%	1.09%	1.54%
15-35	1.90%		1.90%	1.78%	1.85%
36-60	—		1.98%	1.65%	1.77%
61-90	—		2.08%	1.82%	1.97%
91-180	1.95%		2.07%	1.87%	1.93%
>180	2.73%		2.69%	2.41%	2.56%
<b>Total</b>	<b>1.90%</b>		<b>1.88%</b>	<b>1.41%</b>	<b>1.70%</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	19 - 23 jul.				26 - 30 jul.				02 - 06 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	11	52	693	618	59	169	4814	5741	19	94	3987	4420
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	286	367	4	2	3363	2079	3	0	2368	1497
Otros <sup>c</sup>	52	11	156	149	165	57	1100	1419	91	19	436	841
<b>Total</b>	<b>63</b>	<b>63</b>	<b>1135</b>	<b>1134</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>9277</b>	<b>9239</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>6791</b>	<b>6758</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.