

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de agosto de 2021**  
**Fecha de Información: 04 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\$2287 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.12%<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	430,7	323,0	202,4	293,6	9,6	26,1	111
15-35	476,0	842,0	579,7	219,0	19,3	14,1	243
36-60	21,3	5,4	0,0	0,0	5,4	21,3	0
61-90	193,6	6,4	0,0	180,0	1,4	8,6	5
91-180	154,9	136,9	120,0	126,2	1,9	13,7	15
>180	11,5	59,0	59,0	10,0	0,0	1,5	0
<b>Total</b>	<b>1287,9</b>	<b>1372,6</b>	<b>961,1</b>	<b>828,7</b>	<b>37,5</b>	<b>85,2</b>	<b>374</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	1.85%		1.48%	1.77%	1.69%
15-35	1.90%		2.94%	1.79%	2.45%
36-60	—		2.13%	1.80%	1.87%
61-90	1.93%		2.17%	1.77%	1.86%
91-180	1.99%		2.30%	1.98%	1.98%
>180	—		3.25%	7.04%	5.37%
<b>Total</b>	<b>1.89%</b>		<b>2.45%</b>	<b>1.93%</b>	<b>2.12%</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>	24	114	3950	4140	61	135	4176	4695	24	139	3701	4012
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	3	0	2404	2050	0	0	2616	1752	0	0	1929	1328
Otros <sup>c</sup>	111	24	401	549	135	61	630	911	139	24	1056	1340
<b>Total</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>6755</b>	<b>6739</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>7422</b>	<b>7358</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>6686</b>	<b>6680</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.