

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2021**  
**Fecha de Información: 06 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\$1498 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.86%<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         | 345,5                          | 380,1         | 248,7                               | 201,7        | 61,5          | 73,9         | 69,9               |
| 15-35        | 286,8                          | 497,1         | 336,1                               | 125,5        | 17,0          | 17,3         | 144,0              |
| 36-60        | 20,9                           | 27,9          | 17,0                                | 1,0          | 10,9          | 19,9         | 0,0                |
| 61-90        | 21,3                           | 6,5           | 0,0                                 | 6,7          | 6,5           | 14,6         | 0,0                |
| 91-180       | 26,5                           | 16,4          | 0,0                                 | 1,3          | 6,4           | 15,2         | 10,0               |
| >180         | 65,2                           | 78,0          | 26,4                                | 0,0          | 1,6           | 15,2         | 50,0               |
| <b>Total</b> | <b>766,1</b>                   | <b>1006,1</b> | <b>628,2</b>                        | <b>336,2</b> | <b>104,0</b>  | <b>156,1</b> | <b>273,9</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         | 1.93%   |  | 1.62%                        | 1.61%        | 1.66%        |
| 15-35        | 1.99%   |  | 1.92%                        | 1.86%        | 1.93%        |
| 36-60        | —   |  | 2.05%                        | 1.88%        | 1.98%        |
| 61-90        | —   |  | 2.11%                        | 1.82%        | 1.91%        |
| 91-180       | 2.05%   |  | 2.32%                        | 1.92%        | 2.04%        |
| >180         | 2.56%   |  | 2.94%                        | 2.60%        | 2.68%        |
| <b>Total</b> | <b>2.08%</b>                                      |  | <b>1.84%</b>                 | <b>1.75%</b> | <b>1.86%</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                            | 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>      | 11           | 34        | 652         | 729         | 72           | 145        | 4495        | 5148        | 24           | 192        | 3895        | 4249        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0         | 370         | 301         | 0            | 0          | 2878        | 1908        | 0            | 0          | 2045        | 1430        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 34           | 11        | 79          | 66          | 145          | 72         | 721         | 964         | 192          | 24         | 1113        | 1367        |
| <b>Total</b>                        | <b>45</b>    | <b>45</b> | <b>1101</b> | <b>1096</b> | <b>217</b>   | <b>217</b> | <b>8094</b> | <b>8020</b> | <b>216</b>   | <b>216</b> | <b>7053</b> | <b>7046</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.