

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de agosto de 2021**  
**Fecha de Información: 11 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\$3003 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.92%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	539,7	319,4	182,3	457,6	117,6	62,5	19,6
15-35	808,1	1067,7	863,2	474,5	23,7	152,8	180,8
36-60	2,6	62,7	3,6	0,0	59,1	2,6	0,0
61-90	30,1	26,6	0,0	0,0	11,8	15,3	14,8
91-180	176,2	72,9	60,0	80,0	7,9	91,2	5,0
>180	63,8	103,4	40,0	0,0	13,4	13,8	50,0
<b>Total</b>	<b>1620,5</b>	<b>1652,8</b>	<b>1149,1</b>	<b>1012,1</b>	<b>233,4</b>	<b>338,1</b>	<b>270,2</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	1.72%	1.85%	1.67%	1.74%
15-35	2.04%	1.97%	1.81%	1.91%
36-60	—	2.13%	1.76%	2.12%
61-90	2.01%	2.16%	1.92%	2.02%
91-180	2.21%	2.05%	2.02%	2.03%
>180	2.59%	2.66%	2.54%	2.62%
<b>Total</b>	<b>2.12%</b>	<b>1.99%</b>	<b>1.79%</b>	<b>1.92%</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	09 – 13 ago.				16 - 20 ago.				23 - 27 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	64	123	3802	3759	31	214	4198	4986	37	147	4829	4614
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2063	1857	0	0	2392	1537	0	0	2465	1263
Otros <sup>c</sup>	123	64	548	727	214	31	1318	1379	147	37	870	2278
<b>Total</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>6413</b>	<b>6343</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>7908</b>	<b>7902</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>8164</b>	<b>8155</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.