

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de agosto de 2021**  
**Fecha de Información: 17 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\$1525 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.02%<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	518,7	283,0	50,1	304,0	60,2	41,9	172,8
15-35	325,6	624,0	376,5	83,9	61,7	56,0	185,8
36-60	9,4	9,0	0,0	0,0	6,5	6,9	2,5
61-90	17,2	20,6	0,0	0,0	10,6	7,2	10,0
91-180	11,2	56,5	17,0	0,0	34,5	6,2	5,0
>180	8,5	24,6	15,0	0,0	2,4	1,2	7,3
<b>Total</b>	<b>890,7</b>	<b>1017,7</b>	<b>458,5</b>	<b>387,9</b>	<b>175,8</b>	<b>119,4</b>	<b>383,4</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	2.10%		2.00%	1.73%	1.88%
15-35	2.01%		2.15%	1.97%	2.08%
36-60	2.12%		2.43%	1.58%	2.01%
61-90	2.09%		2.25%	1.89%	2.10%
91-180	2.09%		2.40%	2.13%	2.33%
>180	2.85%		2.96%	2.40%	2.90%
<b>Total</b>	<b>2.07%</b>		<b>2.17%</b>	<b>1.80%</b>	<b>2.02%</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	16 – 20 ago.				23 - 27 ago.				30 ago. - 03 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	35	235	5009	5568	45	153	5340	5164	17	179	3344	4333
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2768	2121	0	0	2623	1482	0	0	2892	1540
Otros <sup>c</sup>	235	35	1414	1496	153	45	1009	2316	179	17	513	841
<b>Total</b>	<b>270</b>	<b>270</b>	<b>9191</b>	<b>9185</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>8972</b>	<b>8962</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>6749</b>	<b>6714</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.