

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2021**  
**Fecha de Información: 25 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\$4276 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.00%<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	914,6	1116,2	117,1	594,1	741,1	62,5	258,0
15-35	607,4	893,3	623,6	341,4	48,6	45,0	221,1
36-60	80,8	47,1	0,0	0,0	7,1	40,8	40,0
61-90	57,8	59,9	36,4	47,1	23,5	10,7	0,0
91-180	118,7	14,0	0,0	13,3	14,0	105,4	0,0
>180	638,7	256,1	242,5	50,0	3,6	578,7	10,0
<b>Total</b>	<b>2418,1</b>	<b>2386,8</b>	<b>1019,7</b>	<b>1045,9</b>	<b>837,9</b>	<b>843,1</b>	<b>529,1</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	2.12%		1.24%	2.04%	1.61%
15-35	2.16%		2.16%	2.11%	2.14%
36-60	2.13%		2.41%	2.09%	2.13%
61-90	—		2.26%	2.17%	2.19%
91-180	—		2.48%	2.08%	2.12%
>180	2.67%		2.67%	2.48%	2.52%
<b>Total</b>	<b>2.15%</b>		<b>1.71%</b>	<b>2.23%</b>	<b>2.00%</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	23 – 27 ago.				30 ago. - 03 sept.				06 - 10 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	45	127	5563	5700	27	186	3961	4894	24	104	3687	4511
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2410	2197	0	0	3015	1874	0	0	2695	1425
Otros <sup>c</sup>	127	45	1813	1881	186	27	760	933	104	24	756	731
<b>Total</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>9786</b>	<b>9778</b>	<b>213</b>	<b>213</b>	<b>7736</b>	<b>7701</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>7138</b>	<b>6667</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.