

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 31 de agosto de 2021**  
**Fecha de Información: 27 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\$2994 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.60%<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	273,1	127,8	40,0	165,5	19,8	39,6	68,0
15-35	598,8	1204,2	198,1	312,0	763,2	43,9	242,9
36-60	42,8	36,9	0,0	1,0	36,9	41,8	0,0
61-90	476,0	37,8	3,0	0,0	34,8	476,0	0,0
91-180	292,5	152,1	50,0	15,2	27,1	202,3	75,0
>180	39,4	123,7	80,0	0,0	18,7	14,4	25,0
<b>Total</b>	<b>1722,5</b>	<b>1682,5</b>	<b>371,1</b>	<b>493,7</b>	<b>900,6</b>	<b>817,9</b>	<b>410,9</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.21%		1.97%	1.44%	1.50%
15-35	2.01%		1.10%	1.70%	1.39%
36-60	—		2.30%	2.02%	2.15%
61-90	—		2.38%	1.61%	1.66%
91-180	2.10%		2.27%	1.96%	2.05%
>180	2.32%		2.27%	2.46%	2.30%
<b>Total</b>	<b>1.91%</b>		<b>1.39%</b>	<b>1.70%</b>	<b>1.60%</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 sep.				06 - 10 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	14	35	1905	1847	36	111	4282	5001	31	147	3747	4529
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	737	776	0	0	3051	2231	0	0	2724	1452
Otros <sup>c</sup>	35	14	614	629	111	36	761	827	147	31	714	733
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>3256</b>	<b>3252</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>8094</b>	<b>8059</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>7185</b>	<b>6714</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<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.