

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de septiembre de 2021**  
**Fecha de Información: 30 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\$2670 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.99%<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         | 711,2                          | 313,2         | 37,0                                | 518,4        | 203,2         | 119,9        | 73,0               |
| 15-35        | 459,4                          | 803,1         | 432,8                               | 279,0        | 245,8         | 56,0         | 124,5              |
| 36-60        | 25,4                           | 61,6          | 0,0                                 | 20,0         | 60,3          | 4,2          | 1,3                |
| 61-90        | 35,8                           | 37,5          | 0,0                                 | 0,0          | 37,5          | 35,8         | 0,0                |
| 91-180       | 299,6                          | 88,0          | 20,0                                | 50,0         | 53,0          | 234,6        | 15,0               |
| >180         | 18,0                           | 30,6          | 8,0                                 | 3,5          | 22,6          | 14,5         | 0,0                |
| <b>Total</b> | <b>1549,4</b>                  | <b>1334,1</b> | <b>497,8</b>                        | <b>870,9</b> | <b>622,5</b>  | <b>464,9</b> | <b>213,7</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         | 2.07%   | 1.93%                        | 1.63%        | 1.76%        |
| 15-35        | 2.05%   | 2.08%                        | 2.00%        | 2.05%        |
| 36-60        | 2.08%   | 2.26%                        | 2.01%        | 2.19%        |
| 61-90        | —   | 2.33%                        | 2.04%        | 2.19%        |
| 91-180       | 2.10%   | 2.29%                        | 2.07%        | 2.12%        |
| >180         | —   | 3.03%                        | 2.69%        | 2.88%        |
| <b>Total</b> | <b>2.06%</b>                                      | <b>2.10%</b>                 | <b>1.87%</b> | <b>1.99%</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                            | 30 ago. - 03 sep. |            |             |             | 06 - 10 sep. |            |             |             | 13 - 17 sep. |            |             |             |
|-------------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
|                                     | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery     |            | NDF         |             | Delivery     |            | NDF         |             |
|                                     | C                 | V          | C           | V           | C            | V          | C           | V           | C            | V          | C           | V           |
| Sector Financiero <sup>a</sup>      | 42                | 118        | 4915        | 5233        | 36           | 148        | 3785        | 4616        | 58           | 142        | 5199        | 6373        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0                 | 0          | 3088        | 2714        | 0            | 0          | 2735        | 1467        | 0            | 0          | 3883        | 1651        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 118               | 42         | 902         | 924         | 148          | 36         | 770         | 736         | 142          | 58         | 915         | 1936        |
| <b>Total</b>                        | <b>160</b>        | <b>160</b> | <b>8905</b> | <b>8871</b> | <b>184</b>   | <b>184</b> | <b>7290</b> | <b>6819</b> | <b>200</b>   | <b>200</b> | <b>9997</b> | <b>9960</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.