

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de septiembre de 2021**

**Fecha de Información: 01 de septiembre 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\$3683 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.93%<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	1060,5	172,3	13,6	904,3	29,7	27,2	129,0
15-35	730,6	1028,8	781,0	533,5	75,5	24,8	172,3
36-60	15,4	35,2	3,0	0,0	27,2	10,4	5,0
61-90	18,2	30,6	0,0	0,0	30,6	18,2	0,0
91-180	223,6	573,9	343,1	30,3	58,0	20,6	172,8
>180	42,6	272,3	211,5	0,0	18,6	0,4	42,2
<b>Total</b>	<b>2090,9</b>	<b>2113,0</b>	<b>1352,1</b>	<b>1468,2</b>	<b>239,6</b>	<b>101,4</b>	<b>521,2</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	2.06%	1.94%	1.35%	1.52%
15-35	2.00%	1.92%	1.93%	1.94%
36-60	2.04%	2.13%	1.85%	2.05%
61-90	—	2.29%	2.01%	2.18%
91-180	2.16%	2.24%	2.33%	2.22%
>180	2.75%	2.57%	2.73%	2.61%
<b>Total</b>	<b>2.13%</b>	<b>2.09%</b>	<b>1.61%</b>	<b>1.93%</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 sept.				06 - 10 sept.				13 - 17 sept.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	23	89	3669	3513	38	156	4027	4786	60	147	5695	6640
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2306	2482	0	0	2753	1587	0	0	4020	2026
Otros <sup>c</sup>	89	23	294	252	156	38	811	748	147	60	942	1951
<b>Total</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>6269</b>	<b>6247</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>7591</b>	<b>7121</b>	<b>207</b>	<b>207</b>	<b>10657</b>	<b>10617</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.