

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de marzo de 2021**  
**Fecha de Información: 02 de marzo 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\$2060 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.78%<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	454,7	436,1	244,2	217,9	8,5	53,4	183,4
15-35	646,0	681,0	343,0	275,0	60,0	93,0	277,9
36-60	35,0	107,2	46,9	0,0	34,3	9,0	26,0
61-90	22,2	24,7	0,0	0,0	24,3	21,9	0,4
91-180	26,8	81,9	55,0	0,0	3,4	3,3	23,5
>180	49,3	16,2	5,0	25,0	1,2	14,3	10,0
<b>Total</b>	<b>1234,1</b>	<b>1347,1</b>	<b>694,1</b>	<b>517,9</b>	<b>131,7</b>	<b>194,9</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	0.69%	0.51%	0.47%	0.55%
15-35	0.79%	0.84%	0.73%	0.79%
36-60	0.85%	0.99%	0.88%	0.95%
61-90	1.22%	1.37%	1.07%	1.23%
91-180	1.42%	1.44%	1.01%	1.41%
>180	1.83%	2.04%	1.57%	1.71%
<b>Total</b>	<b>0.81%</b>	<b>0.86%</b>	<b>0.67%</b>	<b>0.78%</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	01 – 05 mar.				08 - 12 mar.				15 - 19 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	24	98	4566	3941	32	96	4640	3975	23	129	6178	5934
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	1	2024	2205	0	0	2316	2025	0	0	3213	2507
Otros <sup>c</sup>	98	24	322	739	96	32	456	1009	129	23	1219	2153
<b>Total</b>	<b>122</b>	<b>123</b>	<b>6912</b>	<b>6885</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>7412</b>	<b>7009</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>10610</b>	<b>10594</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.