

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2021**  
**Fecha de Información: 09 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\$3014 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.52%<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	613,9	860,8	398,6	425,3	344,3	70,6	118,0
15-35	606,1	507,7	288,8	377,1	47,0	57,0	172,0
36-60	38,2	40,5	0,0	0,0	22,5	20,2	18,0
61-90	386,9	37,7	21,1	0,0	16,6	386,9	0,0
91-180	75,0	79,1	60,0	2,0	19,1	73,0	0,0
>180	43,4	32,9	30,1	30,1	2,2	12,7	0,6
<b>Total</b>	<b>1763,4</b>	<b>1558,8</b>	<b>798,5</b>	<b>834,5</b>	<b>451,7</b>	<b>620,3</b>	<b>308,6</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	0.60%	0.29%	0.25%	0.31%
15-35	0.34%	0.47%	0.32%	0.38%
36-60	0.43%	0.92%	0.34%	0.58%
61-90	—	1.43%	0.92%	0.94%
91-180	—	1.39%	1.27%	1.32%
>180	1.45%	2.08%	1.69%	1.74%
<b>Total</b>	<b>0.45%</b>	<b>0.47%</b>	<b>0.58%</b>	<b>0.52%</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	08 – 12 mar.				15 - 19 mar.				22 - 26 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	31	94	5335	4407	26	134	7190	7354	31	102	2778	1876
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2274	2398	0	0	3630	3098	0	0	755	839
Otros <sup>c</sup>	94	31	511	914	134	26	1885	2238	102	31	638	1455
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>8120</b>	<b>7719</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>12705</b>	<b>12690</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>4171</b>	<b>4170</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.