

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2021**  
**Fecha de Información: 12 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\$4375 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.57%<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	928,8	1347,1	509,8	719,3	749,2	121,4	88,1
15-35	445,1	479,3	326,7	306,4	82,7	68,7	70,0
36-60	194,5	14,4	0,2	0,0	13,8	194,2	0,3
61-90	92,9	15,0	0,0	9,6	15,0	83,3	0,0
91-180	602,4	414,2	311,0	100,0	68,2	467,4	35,0
>180	7,5	27,8	20,0	0,0	7,4	7,1	0,4
<b>Total</b>	<b>2271,2</b>	<b>2297,8</b>	<b>1167,7</b>	<b>1135,3</b>	<b>936,3</b>	<b>942,1</b>	<b>193,8</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	0.42%		0.27%	0.22%	0.26%
15-35	0.40%		0.40%	0.32%	0.37%
36-60	0.84%		1.13%	0.80%	0.82%
61-90	—		1.26%	1.00%	1.04%
91-180	1.25%		1.25%	1.19%	1.21%
>180	1.46%		1.81%	1.14%	1.48%
<b>Total</b>	<b>0.57%</b>		<b>0.48%</b>	<b>0.65%</b>	<b>0.57%</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>	7	38	957	929	28	132	8487	9280	32	105	3006	2055
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	528	575	0	0	4245	4073	0	0	880	1002
Otros <sup>c</sup>	38	7	97	78	132	28	3000	2363	105	32	675	1503
<b>Total</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>1582</b>	<b>1582</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>15732</b>	<b>15716</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>4561</b>	<b>4560</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.