

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de marzo de 2021**  
**Fecha de Información: 17 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\$2396 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.49%<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	679,7	474,6	421,5	613,4	10,6	23,9	42,4
15-35	418,0	756,3	662,9	300,3	30,0	54,3	63,4
36-60	44,1	22,1	1,3	40,0	20,7	4,1	0,0
61-90	26,4	10,3	2,4	0,0	7,6	26,2	0,2
91-180	36,1	7,2	0,0	30,6	7,2	5,5	0,0
>180	20,9	6,9	0,0	2,8	6,9	18,1	0,0
<b>Total</b>	<b>1225,2</b>	<b>1277,4</b>	<b>1088,1</b>	<b>987,0</b>	<b>83,1</b>	<b>132,1</b>	<b>106,1</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	0.24%		0.78%	0.31%	0.46%
15-35	0.36%		0.38%	0.51%	0.42%
36-60	—		1.00%	0.46%	0.71%
61-90	1.02%		1.22%	1.10%	1.13%
91-180	—		1.67%	1.15%	1.45%
>180	—		1.95%	1.77%	1.82%
<b>Total</b>	<b>0.31%</b>		<b>0.56%</b>	<b>0.46%</b>	<b>0.49%</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	15 – 19 mar.				22 - 26 mar.				29 mar. - 02 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	22	99	5063	5198	33	106	3226	2484	24	83	4707	4687
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2625	3041	0	0	1122	1128	2	0	2591	2132
Otros <sup>c</sup>	99	22	1518	961	106	33	811	1545	80	24	366	845
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>9206</b>	<b>9200</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>5159</b>	<b>5157</b>	<b>106</b>	<b>107</b>	<b>7664</b>	<b>7664</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.