

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2021**  
**Fecha de Información: 19 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\$2395 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.67%<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	239,6	335,0	157,9	140,0	177,2	99,6	0,0
15-35	733,9	598,9	178,6	286,3	104,9	132,3	315,3
36-60	11,1	45,5	7,0	0,0	38,5	11,1	0,0
61-90	67,6	110,1	12,6	0,0	47,5	17,6	50,0
91-180	312,5	411,3	160,0	70,0	16,3	7,5	235,0
>180	48,2	101,8	70,0	10,0	11,8	18,2	20,0
<b>Total</b>	<b>1412,9</b>	<b>1602,6</b>	<b>586,1</b>	<b>506,3</b>	<b>396,2</b>	<b>286,3</b>	<b>620,3</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	–		0.46%	0.13%	0.32%
15-35	0.43%		0.53%	0.36%	0.42%
36-60	–		0.59%	0.37%	0.54%
61-90	0.92%		1.15%	1.07%	1.05%
91-180	1.14%		1.14%	1.43%	1.18%
>180	1.43%		1.70%	1.42%	1.58%
<b>Total</b>	<b>0.77%</b>		<b>0.76%</b>	<b>0.45%</b>	<b>0.67%</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>	7	40	1246	1385	44	110	3348	2894	25	82	4962	5157
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	774	709	0	0	1454	1189	2	0	2767	2282
Otros <sup>c</sup>	40	7	301	227	110	44	889	1606	79	24	597	887
<b>Total</b>	<b>47</b>	<b>47</b>	<b>2321</b>	<b>2321</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>5691</b>	<b>5689</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>8326</b>	<b>8326</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.