

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de abril de 2021**  
**Fecha de Información: 30 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\$1921 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.33%<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	394,9	378,4	203,0	236,6	26,9	9,8	148,5
15-35	523,0	587,5	396,4	328,0	0,0	68,0	127,0
36-60	56,2	21,5	0,0	0,0	21,5	56,2	0,0
61-90	18,3	10,3	0,7	0,0	0,0	18,3	0,0
91-180	18,8	51,4	0,0	0,0	0,0	18,3	0,5
>180	104,6	80,4	30,0	33,2	1,9	23,0	48,5
<b>Total</b>	<b>1115,8</b>	<b>1129,4</b>	<b>630,1</b>	<b>597,8</b>	<b>50,3</b>	<b>193,5</b>	<b>324,5</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	0.22%		0.11%	0.16%	0.15%
15-35	0.11%		0.18%	0.04%	0.11%
36-60	—		0.58%	0.11%	0.24%
61-90	0.52%		1.10%	0.56%	0.74%
91-180	0.96%		1.21%	0.97%	1.14%
>180	1.87%		1.91%	1.65%	1.78%
<b>Total</b>	<b>0.42%</b>		<b>0.32%</b>	<b>0.29%</b>	<b>0.33%</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	29 mar. - 02 abr.				05 - 09 abr.				12 - 16 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	11	68	4306	4382	61	189	5983	5667	46	113	4588	5151
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	2	0	2590	2264	0	0	3052	3262	0	0	3129	1878
Otros <sup>c</sup>	65	10	428	677	189	61	621	718	113	46	650	1325
<b>Total</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>7324</b>	<b>7323</b>	<b>250</b>	<b>250</b>	<b>9656</b>	<b>9647</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>8367</b>	<b>8354</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.