

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de abril de 2021**  
**Fecha de Información: 31 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\$1238 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.30%<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	174,9	120,5	90,3	147,5	20,2	17,4	10
15-35	316,3	450,3	360,2	207,8	15,1	33,5	75
36-60	7,9	104,4	75,0	0,0	29,4	7,9	0
61-90	5,6	12,9	4,7	0,0	8,2	5,6	0
91-180	18,5	39,9	0,0	0,0	39,9	18,5	0
>180	46,5	66,8	5,0	1,0	20,8	4,5	41
<b>Total</b>	<b>569,8</b>	<b>794,6</b>	<b>535,2</b>	<b>356,3</b>	<b>133,5</b>	<b>87,4</b>	<b>126</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	0.12%		0.11%	-0.05%	0.03%
15-35	0.18%		0.10%	0.01%	0.07%
36-60	—		0.46%	0.22%	0.43%
61-90	—		1.14%	0.52%	0.89%
91-180	—		1.29%	0.95%	1.18%
>180	1.84%		1.63%	1.41%	1.74%
<b>Total</b>	<b>0.71%</b>		<b>0.37%</b>	<b>0.08%</b>	<b>0.30%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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>	6	27	450	527	62	194	6120	5785	46	113	4686	5172
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	327	304	0	0	3111	3339	0	0	3149	1972
Otros <sup>c</sup>	27	6	134	81	194	62	636	734	113	46	651	1328
<b>Total</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>911</b>	<b>912</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>9867</b>	<b>9858</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>8486</b>	<b>8472</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.