

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 23 de abril de 2021**  
**Fecha de Información: 21 de abril 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\$1819 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.38%<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	507,9	283,7	193,9	418,3	31,8	31,5	58,0
15-35	387,6	582,5	384,5	160,5	30,4	59,5	167,6
36-60	17,0	10,8	0,0	0,0	10,8	17,0	0,0
61-90	69,2	15,1	0,0	50,0	10,1	14,2	5,0
91-180	66,1	105,6	70,0	5,0	23,1	48,6	12,6
>180	8,4	15,3	4,0	0,0	4,2	1,4	7,1
<b>Total</b>	<b>1056,2</b>	<b>1013,1</b>	<b>652,4</b>	<b>633,8</b>	<b>110,5</b>	<b>172,1</b>	<b>250,2</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	1.47%		1.29%	1.27%	1.29%
15-35	1.44%		1.46%	1.32%	1.42%
36-60	—		1.69%	1.32%	1.46%
61-90	1.51%		1.74%	1.31%	1.49%
91-180	1.49%		1.63%	1.50%	1.55%
>180	1.84%		1.91%	1.67%	1.86%
<b>Total</b>	<b>1.46%</b>		<b>1.43%</b>	<b>1.30%</b>	<b>1.38%</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	19 – 23 abr.				26 - 30 abr.				03 - 07 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	27	108	5073	5118	46	139	3684	4271	25	95	3673	3419
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2837	2495	0	0	2597	1431	0	0	2120	1210
Otros <sup>c</sup>	108	27	615	888	139	46	645	1208	95	25	334	1482
<b>Total</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>8525</b>	<b>8501</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>6926</b>	<b>6910</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>6127</b>	<b>6111</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.