

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de abril de 2021**  
**Fecha de Información: 28 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\$1791 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.73%<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	309,7	330,3	129,0	172,5	77,9	13,7	123,5
15-35	399,8	525,5	395,2	236,5	7,8	40,9	122,5
36-60	24,8	27,7	1,3	0,6	9,3	7,0	17,2
61-90	164,6	88,5	0,6	1,9	22,8	97,7	65,0
91-180	92,8	110,8	30,0	0,0	19,0	31,0	61,8
>180	88,5	20,7	0,0	80,1	18,2	5,9	2,5
<b>Total</b>	<b>1080,2</b>	<b>1103,5</b>	<b>556,1</b>	<b>491,6</b>	<b>155,0</b>	<b>196,1</b>	<b>392,5</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	1.74%		1.77%	1.65%	1.73%
15-35	1.76%		1.83%	1.66%	1.74%
36-60	1.74%		2.14%	1.50%	1.80%
61-90	1.75%		1.81%	1.59%	1.67%
91-180	1.75%		1.84%	1.62%	1.74%
>180	2.07%		1.89%	1.76%	1.87%
<b>Total</b>	<b>1.75%</b>		<b>1.82%</b>	<b>1.64%</b>	<b>1.73%</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	26 – 30 abr.				03 - 07 may.				10 - 14 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	28	124	3141	3372	37	97	4166	4123	47	124	5642	5342
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1882	1473	0	0	2482	1404	0	0	3023	1965
Otros <sup>c</sup>	124	28	585	745	97	37	428	1523	124	47	615	1958
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>5608</b>	<b>5590</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>7076</b>	<b>7050</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>9280</b>	<b>9265</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.