

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 09 de abril de 2021**  
**Fecha de Información: 07 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\$1570 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.51%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	258,4	341,2	217,5	156,6	71,8	49,8	52,0
15-35	358,1	506,5	306,8	168,6	53,3	42,9	146,5
36-60	77,7	56,3	1,1	20,0	35,1	37,7	20,1
61-90	24,2	32,8	0,0	1,6	32,7	22,5	0,1
91-180	33,6	48,7	0,0	0,0	18,6	3,5	30,1
>180	74,8	76,9	0,0	0,0	6,5	4,4	70,4
<b>Total</b>	<b>826,8</b>	<b>1062,5</b>	<b>525,3</b>	<b>346,8</b>	<b>218,0</b>	<b>160,9</b>	<b>319,1</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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	0.63%		0.76%	-2.49%	-0.74%
15-35	0.85%		0.87%	0.92%	0.87%
36-60	1.33%		1.09%	0.95%	1.06%
61-90	1.12%		1.68%	1.46%	1.59%
91-180	1.59%		1.67%	1.43%	1.61%
>180	1.67%		1.64%	0.97%	1.63%
<b>Total</b>	<b>1.10%</b>		<b>0.94%</b>	<b>-0.63%</b>	<b>0.51%</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	05 – 09 abr.				12 - 16 abr.				19 - 23 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	26	164	4536	4467	48	116	5258	5652	21	125	4044	4419
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2338	2477	0	0	3348	2332	0	0	2651	1801
Otros <sup>c</sup>	164	26	514	443	116	48	732	1333	125	21	431	881
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>7388</b>	<b>7387</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>9338</b>	<b>9317</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>7126</b>	<b>7101</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.