

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de abril de 2021**  
**Fecha de Información: 08 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\$1987 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.16%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	355,5	491,8	208,0	184,4	135,3	22,6	148,5
15-35	517,2	484,2	242,2	265,7	19,7	29,2	222,3
36-60	1,8	132,6	100,0	0,0	32,6	1,8	0,0
61-90	102,1	8,0	0,3	0,0	7,7	102,1	0,0
91-180	52,2	146,1	50,0	0,0	46,1	2,2	50,0
>180	62,2	110,4	52,0	0,0	2,4	6,2	56,0
<b>Total</b>	<b>1090,9</b>	<b>1373,2</b>	<b>652,5</b>	<b>450,1</b>	<b>243,8</b>	<b>163,9</b>	<b>476,8</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	1.10%		1.05%	0.96%	1.04%
15-35	1.17%		1.14%	1.04%	1.12%
36-60	-		1.28%	1.04%	1.26%
61-90	-		1.57%	1.29%	1.31%
91-180	1.57%		1.69%	0.95%	1.61%
>180	1.72%		2.25%	1.31%	1.70%
<b>Total</b>	<b>1.25%</b>		<b>1.15%</b>	<b>1.07%</b>	<b>1.16%</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>	17	126	3399	3470	48	120	5513	5963	21	125	4092	4492
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1816	1746	0	0	3426	2461	0	0	2686	1813
Otros <sup>c</sup>	126	17	313	310	120	48	857	1351	125	21	433	882
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5528</b>	<b>5526</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>9796</b>	<b>9775</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>7211</b>	<b>7187</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.