

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de abril de 2021**  
**Fecha de Información: 14 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\$4816 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.40%<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	1635,0	1146,7	356,1	983,2	601,8	463,0	188,8
15-35	571,2	1223,8	933,5	264,5	5,5	21,9	284,8
36-60	31,8	45,5	11,5	0,0	34,0	31,8	0,0
61-90	8,3	65,5	29,3	0,0	36,2	8,3	0,0
91-180	368,7	206,5	60,0	61,5	36,5	197,2	110,0
>180	53,8	64,7	40,0	30,0	3,1	2,3	21,5
<b>Total</b>	<b>2668,8</b>	<b>2752,6</b>	<b>1430,4</b>	<b>1339,2</b>	<b>717,1</b>	<b>724,5</b>	<b>605,2</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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	1.45%		1.34%	1.30%	1.33%
15-35	1.45%		1.43%	1.43%	1.44%
36-60	-		1.63%	1.34%	1.51%
61-90	-		1.85%	1.43%	1.77%
91-180	1.59%		1.64%	1.48%	1.54%
>180	1.71%		1.89%	1.71%	1.74%
<b>Total</b>	<b>1.48%</b>		<b>1.41%</b>	<b>1.35%</b>	<b>1.40%</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	12 – 16 abr.				19 - 23 abr.				26 - 30 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	30	104	5276	5779	26	129	4871	5117	41	121	2693	3704
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2841	2688	0	0	3038	2183	0	0	2254	974
Otros <sup>c</sup>	104	30	1440	1076	129	26	558	1142	121	41	589	839
<b>Total</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>9557</b>	<b>9543</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>8467</b>	<b>8442</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>5536</b>	<b>5517</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.