

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 21 de abril de 2021**  
**Fecha de Información: 19 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\$1937 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.36%<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	407,1	446,0	312,3	230,5	28,7	71,6	105,0
15-35	346,9	459,0	255,7	209,6	77,9	11,9	125,4
36-60	47,3	60,4	32,9	33,2	22,5	9,1	5,0
61-90	84,5	72,8	0,0	0,0	42,8	54,5	30,0
91-180	111,3	9,0	0,0	106,3	8,6	4,5	0,4
>180	89,9	104,2	64,0	10,0	5,2	44,9	35,0
<b>Total</b>	<b>1086,9</b>	<b>1151,3</b>	<b>664,8</b>	<b>589,6</b>	<b>185,7</b>	<b>196,5</b>	<b>300,8</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	1.33%		0.93%	1.02%	1.07%
15-35	1.32%		1.34%	1.25%	1.31%
36-60	1.45%		1.51%	1.16%	1.45%
61-90	1.50%		1.52%	1.38%	1.46%
91-180	1.58%		1.86%	1.09%	1.59%
>180	1.82%		2.74%	2.64%	2.46%
<b>Total</b>	<b>1.40%</b>		<b>1.42%</b>	<b>1.28%</b>	<b>1.36%</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>	35	143	6277	6305	42	138	2915	3875	23	96	3607	3342
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3630	3023	0	0	2352	1156	0	0	2082	1183
Otros <sup>c</sup>	143	35	769	1324	138	42	636	855	96	23	331	1478
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>10676</b>	<b>10652</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>5903</b>	<b>5886</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>6020</b>	<b>6003</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.