

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2021**  
**Fecha de Información: 27 de mayo 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\$3214 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.00%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupa y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	786,5	566,1	87,3	303,6	14,8	18,9	464,0
15-35	700,4	1204,1	671,5	334,5	183,9	17,3	348,7
36-60	13,1	32,4	0,0	0,0	32,4	13,1	0,0
61-90	36,5	105,7	20,0	0,0	55,7	6,5	30,0
91-180	443,1	430,1	50,0	0,0	25,1	88,1	355,0
>180	78,8	90,3	10,6	0,0	4,7	3,8	75,0
<b>Total</b>	<b>2058,3</b>	<b>2428,8</b>	<b>839,4</b>	<b>638,1</b>	<b>316,7</b>	<b>147,5</b>	<b>1272,7</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	2.05%		2.15%	1.93%	2.02%
15-35	2.03%		2.05%	1.96%	2.03%
36-60	-		2.04%	1.79%	1.97%
61-90	1.88%		1.99%	1.79%	1.95%
91-180	1.87%		1.98%	1.75%	1.86%
>180	2.34%		2.10%	1.58%	2.29%
<b>Total</b>	<b>2.00%</b>		<b>2.05%</b>	<b>1.90%</b>	<b>2.00%</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	24 – 28 may.				31 may. - 04 jun.				07 - 11 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	42	164	1835	1992	105	192	3178	4076	28	104	4754	5292
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1142	702	0	0	2472	1449	0	0	3243	2016
Otros <sup>c</sup>	164	42	433	710	192	105	466	566	104	28	599	874
<b>Total</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>3410</b>	<b>3404</b>	<b>297</b>	<b>297</b>	<b>6116</b>	<b>6091</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>8596</b>	<b>8182</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.