

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2021**  
**Fecha de Información: 10 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\$1384 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.67%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	329,9	162,7	75,0	221,8	20,2	40,5	67,5
15-35	413,3	551,6	254,7	197,3	104,4	23,5	192,5
36-60	18,2	38,7	0,0	0,0	38,7	18,2	0,0
61-90	22,9	22,7	2,7	0,0	20,1	22,9	0,0
91-180	3,3	35,4	2,7	0,0	32,7	3,3	0,0
>180	11,3	35,5	20,3	0,0	14,2	10,3	1,0
<b>Total</b>	<b>798,8</b>	<b>846,6</b>	<b>355,4</b>	<b>419,1</b>	<b>230,2</b>	<b>118,7</b>	<b>261,0</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	1.71%		1.63%	1.56%	1.60%
15-35	1.73%		1.75%	1.37%	1.65%
36-60	—		1.96%	1.66%	1.86%
61-90	—		1.99%	1.56%	1.76%
91-180	—		2.07%	1.50%	2.01%
>180	1.80%		2.15%	1.89%	2.03%
<b>Total</b>	<b>1.72%</b>		<b>1.80%</b>	<b>1.50%</b>	<b>1.67%</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	10 – 14 may.				17 - 21 may.				24 - 28 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	101	141	6625	7144	23	115	3652	3966	129	193	4286	5125
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4020	2386	0	0	2471	953	0	0	2879	1418
Otros <sup>c</sup>	141	101	1005	2106	115	23	433	1611	193	129	731	1348
<b>Total</b>	<b>242</b>	<b>242</b>	<b>11650</b>	<b>11636</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>6556</b>	<b>6530</b>	<b>322</b>	<b>322</b>	<b>7896</b>	<b>7891</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.