

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2021**  
**Fecha de Información: 11 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\$1907 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.71%<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	455,5	324,9	181,8	346,0	99,0	65,5	44,0
15-35	459,5	449,2	299,9	360,7	61,4	11,0	87,8
36-60	9,1	108,5	60,0	0,0	43,0	3,6	5,5
61-90	0,4	15,6	0,8	0,0	14,9	0,4	0,0
91-180	26,7	72,7	0,0	20,0	72,3	6,3	0,4
>180	55,4	68,2	46,0	40,0	20,8	14,0	1,4
<b>Total</b>	<b>1006,6</b>	<b>1039,0</b>	<b>588,5</b>	<b>766,7</b>	<b>311,3</b>	<b>100,8</b>	<b>139,1</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	1.69%		1.75%	1.38%	1.54%
15-35	1.73%		1.82%	1.69%	1.76%
36-60	1.77%		2.08%	1.63%	2.03%
61-90	—		1.94%	1.57%	1.93%
91-180	1.72%		1.99%	1.71%	1.91%
>180	1.94%		2.11%	2.24%	2.18%
<b>Total</b>	<b>1.72%</b>		<b>1.85%</b>	<b>1.55%</b>	<b>1.71%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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>	102	121	5220	5527	23	121	3757	4086	126	195	4384	5248
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2935	1914	0	0	2536	1037	0	0	2897	1494
Otros <sup>c</sup>	121	102	870	1569	121	23	481	1624	195	126	818	1347
<b>Total</b>	<b>223</b>	<b>223</b>	<b>9025</b>	<b>9010</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>6774</b>	<b>6747</b>	<b>321</b>	<b>321</b>	<b>8099</b>	<b>8089</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.