

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2021**  
**Fecha de Información: 13 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\$2980 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.65%<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	543,2	176,1	106,5	472,7	46,6	47,5	23,0
15-35	463,7	1235,7	659,7	259,8	378,9	7,0	197,0
36-60	23,9	23,8	0,0	0,0	23,4	23,5	0,4
61-90	10,6	50,8	0,0	0,0	50,8	10,6	0,0
91-180	373,5	168,7	130,0	0,0	27,7	362,5	11,0
>180	114,6	112,6	23,0	20,0	4,1	9,1	85,4
<b>Total</b>	<b>1529,6</b>	<b>1767,6</b>	<b>919,2</b>	<b>752,5</b>	<b>531,6</b>	<b>460,2</b>	<b>316,9</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	1.77%		0.89%	1.13%	1.12%
15-35	1.80%		1.82%	1.60%	1.79%
36-60	1.76%		1.92%	1.67%	1.80%
61-90	—		1.92%	1.64%	1.87%
91-180	1.82%		1.89%	1.70%	1.74%
>180	2.36%		2.26%	2.16%	2.31%
<b>Total</b>	<b>1.95%</b>		<b>1.77%</b>	<b>1.43%</b>	<b>1.65%</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>	45	78	4387	4370	89	125	4129	4240	127	197	4478	5323
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2222	1768	0	0	2642	1346	0	0	2961	1535
Otros <sup>c</sup>	78	45	751	1206	125	89	493	1653	197	127	829	1400
<b>Total</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>7360</b>	<b>7344</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>7264</b>	<b>7239</b>	<b>324</b>	<b>324</b>	<b>8268</b>	<b>8258</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.