

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2021**  
**Fecha de Información: 14 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\$2935 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.41%<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	482,0	243,4	56,0	367,5	91,1	18,2	96,3
15-35	555,7	903,1	435,7	255,3	294,4	127,4	173,0
36-60	14,3	32,9	0,0	0,0	22,6	4,1	10,2
61-90	2,1	251,5	10,0	0,0	241,5	2,1	0,0
91-180	441,0	184,7	37,2	0,0	107,5	401,0	40,0
>180	127,6	136,6	10,0	0,0	6,6	7,6	120,0
<b>Total</b>	<b>1622,7</b>	<b>1752,2</b>	<b>548,9</b>	<b>622,8</b>	<b>763,8</b>	<b>560,4</b>	<b>439,5</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	1.76%		1.63%	1.38%	1.49%
15-35	1.77%		1.33%	1.60%	1.46%
36-60	1.87%		2.06%	1.57%	1.95%
61-90	—		0.42%	1.70%	0.43%
91-180	1.80%		2.09%	1.20%	1.42%
>180	2.26%		2.09%	1.79%	2.22%
<b>Total</b>	<b>1.91%</b>		<b>1.27%</b>	<b>1.38%</b>	<b>1.41%</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>	9	36	1480	1477	100	137	4738	4459	127	204	4513	5446
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	869	617	0	0	2692	1833	0	0	3065	1563
Otros <sup>c</sup>	36	9	172	427	137	100	556	1669	204	127	844	1404
<b>Total</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>2521</b>	<b>2521</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>7986</b>	<b>7961</b>	<b>331</b>	<b>331</b>	<b>8422</b>	<b>8413</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.