

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2021**  
**Fecha de Información: 19 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\$1559 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.68%<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	360,0	452,3	141,0	130,0	135,1	53,8	176,2
15-35	413,5	328,8	196,9	256,5	36,2	61,3	95,7
36-60	21,3	46,7	0,8	0,0	45,9	21,3	0,0
61-90	45,4	105,7	0,0	0,0	65,7	5,4	40,0
91-180	57,8	74,5	5,0	0,0	19,5	7,8	50,0
>180	2,8	11,8	0,0	0,0	11,8	2,8	0,0
<b>Total</b>	<b>900,8</b>	<b>1019,8</b>	<b>343,7</b>	<b>386,5</b>	<b>314,2</b>	<b>152,4</b>	<b>361,9</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	1.78%		1.73%	1.21%	1.59%
15-35	1.74%		1.77%	1.64%	1.71%
36-60	—		1.95%	1.54%	1.82%
61-90	1.84%		1.58%	1.30%	1.66%
91-180	1.93%		2.05%	1.67%	1.93%
>180	—		2.20%	2.14%	2.19%
<b>Total</b>	<b>1.80%</b>		<b>1.77%</b>	<b>1.47%</b>	<b>1.68%</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	17 - 21 may.				24 - 28 may.				31 may. - 04 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	89	107	4588	3955	133	225	4767	5862	91	99	2408	3568
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2318	1925	0	0	3209	1630	0	0	2335	981
Otros <sup>c</sup>	107	89	507	1526	225	133	950	1426	99	91	350	519
<b>Total</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>7413</b>	<b>7406</b>	<b>358</b>	<b>358</b>	<b>8926</b>	<b>8918</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>5093</b>	<b>5068</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.