

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2021**  
**Fecha de Información: 21 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\$1566 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> |               | Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup> |              | Otros Agentes |              | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
|              | Compras                        | Ventas        | Compras                              | Ventas       | Compras       | Ventas       |                                      |
| 3-14         | 357,8                          | 214,6         | 83,8                                 | 242,6        | 65,3          | 49,7         | 65,5                                 |
| 15-35        | 280,0                          | 594,1         | 427,5                                | 107,2        | 36,8          | 43,0         | 129,8                                |
| 36-60        | 28,4                           | 19,9          | 0,0                                  | 0,2          | 19,9          | 28,3         | 0,0                                  |
| 61-90        | 68,2                           | 102,2         | 15,5                                 | 0,1          | 26,3          | 7,8          | 60,4                                 |
| 91-180       | 86,8                           | 96,5          | 2,6                                  | 0,0          | 13,0          | 5,9          | 80,9                                 |
| >180         | 35,9                           | 17,7          | 6,0                                  | 30,3         | 11,7          | 5,7          | 0,0                                  |
| <b>Total</b> | <b>857,2</b>                   | <b>1045,0</b> | <b>535,5</b>                         | <b>380,4</b> | <b>172,9</b>  | <b>140,3</b> | <b>336,6</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 |              | Total        |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas                                    |  | Compras                      | Ventas       |              |
| 3-14         | 1.82%   |  | 1.85%                        | 1.28%        | 1.50%        |
| 15-35        | 1.85%   |  | 1.79%                        | 1.68%        | 1.78%        |
| 36-60        | -   |  | 1.70%                        | 1.66%        | 1.68%        |
| 61-90        | 1.82%   |  | 1.91%                        | 1.55%        | 1.84%        |
| 91-180       | 1.94%   |  | 2.04%                        | 1.69%        | 1.94%        |
| >180         | -   |  | 2.52%                        | 1.77%        | 2.34%        |
| <b>Total</b> | <b>1.86%</b>                                      |  | <b>1.84%</b>                 | <b>1.43%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(365/\text{Plazo})}) - 1$ . 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>      | 13           | 28        | 674         | 457         | 138          | 238        | 5235        | 6105        | 93                | 185        | 2512        | 3737        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0            | 0         | 301         | 236         | 0            | 0          | 3378        | 1990        | 0                 | 0          | 2398        | 991         |
| Otros <sup>c</sup>                  | 28           | 13        | 77          | 358         | 238          | 138        | 967         | 1476        | 185               | 93         | 388         | 545         |
| <b>Total</b>                        | <b>41</b>    | <b>41</b> | <b>1052</b> | <b>1051</b> | <b>376</b>   | <b>376</b> | <b>9580</b> | <b>9571</b> | <b>278</b>        | <b>278</b> | <b>5298</b> | <b>5273</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.