

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 07 de octubre de 2021**  
**Fecha de Información: 05 de octubre 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\$2848 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.32%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	718,2	484,1	220,9	354,0	39,2	140,2	224,0
15-35	760,4	638,0	326,8	459,7	73,8	63,2	237,5
36-60	64,3	60,8	10,0	0,0	10,8	24,3	40,0
61-90	11,5	171,3	3,3	1,5	168,0	10,0	0,0
91-180	173,9	69,6	20,0	140,0	19,6	3,9	30,0
>180	125,2	182,5	80,0	20,0	22,5	25,2	80,0
<b>Total</b>	<b>1853,5</b>	<b>1606,2</b>	<b>660,9</b>	<b>975,2</b>	<b>333,8</b>	<b>266,7</b>	<b>611,5</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.37%	1.42%	2.00%	1.99%
15-35	2.26%	2.35%	2.27%	2.30%
36-60	2.43%	2.66%	2.33%	2.43%
61-90	—	2.45%	2.32%	2.44%
91-180	2.52%	2.69%	2.45%	2.51%
>180	3.32%	3.26%	4.08%	3.42%
<b>Total</b>	<b>2.47%</b>	<b>2.31%</b>	<b>2.22%</b>	<b>2.32%</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	04 – 08 oct.				11 - 15 oct.				18 - 22 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	37	107	6461	6620	49	134	4451	4702	27	154	3145	3384
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3513	3326	0	0	2717	1901	0	0	1480	923
Otros <sup>c</sup>	107	37	1068	1000	134	49	689	1062	154	27	664	970
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>11042</b>	<b>10946</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>7857</b>	<b>7665</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>5289</b>	<b>5277</b>

<sup>a</sup> Cifras en millones de dólares.

<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.