

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de octubre de 2021**  
**Fecha de Información: 12 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\$2352 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.03%<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	565,7	357,5	295,7	528,9	41,3	16,3	20,5
15-35	450,3	535,0	342,8	272,0	48,7	34,8	143,5
36-60	60,5	112,1	26,6	2,9	40,5	12,5	45,0
61-90	108,0	44,1	0,0	4,0	42,8	102,7	1,2
91-180	157,6	136,1	7,5	126,9	121,1	23,2	7,5
>180	14,1	40,1	13,3	0,0	15,3	2,6	11,5
<b>Total</b>	<b>1356,1</b>	<b>1224,8</b>	<b>685,9</b>	<b>934,7</b>	<b>309,7</b>	<b>192,2</b>	<b>229,2</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	1.15%	2.03%	1.69%	1.77%
15-35	1.97%	1.99%	1.93%	1.97%
36-60	2.16%	2.43%	1.90%	2.24%
61-90	2.23%	2.54%	2.09%	2.22%
91-180	2.30%	2.77%	2.49%	2.69%
>180	2.96%	3.14%	3.10%	3.06%
<b>Total</b>	<b>1.99%</b>	<b>2.21%</b>	<b>1.86%</b>	<b>2.03%</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	11 – 15 oct.				18 - 22 oct.				25 - 29 oct.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	56	147	5515	5263	28	163	3532	3860	35	178	4434	5229
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3053	2688	0	0	1661	1022	0	0	2611	1485
Otros <sup>c</sup>	147	56	728	1135	163	28	705	994	178	35	1245	1495
<b>Total</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>9296</b>	<b>9086</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>5898</b>	<b>5876</b>	<b>213</b>	<b>213</b>	<b>8290</b>	<b>8209</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.