

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2021**  
**Fecha de Información: 13 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\$4159 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.93%<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	328,6	593,1	135,4	255,2	414,2	29,9	43,5
15-35	687,1	858,8	560,3	409,1	48,1	27,5	250,5
36-60	13,5	61,6	46,5	0,0	15,1	13,5	0,0
61-90	216,4	462,1	327,9	100,0	24,2	6,4	110,0
91-180	942,5	148,2	0,0	502,2	108,2	400,3	40,0
>180	131,8	170,3	135,5	120,0	23,3	0,3	11,5
<b>Total</b>	<b>2320,1</b>	<b>2294,1</b>	<b>1205,6</b>	<b>1386,6</b>	<b>633,0</b>	<b>478,0</b>	<b>455,5</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	1.96%	1.26%	1.74%	1.45%
15-35	1.95%	1.94%	1.42%	1.79%
36-60	—	2.38%	1.92%	2.16%
61-90	2.18%	2.46%	2.17%	2.22%
91-180	2.51%	2.79%	2.54%	2.59%
>180	2.92%	3.38%	3.54%	3.23%
<b>Total</b>	<b>2.08%</b>	<b>1.79%</b>	<b>2.01%</b>	<b>1.93%</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>	36	118	5013	5067	29	166	3594	3892	37	181	4578	5334
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2710	2447	0	0	1661	1054	0	0	2678	1568
Otros <sup>c</sup>	118	36	903	927	166	29	721	1009	181	37	1240	1514
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>8626</b>	<b>8441</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>5976</b>	<b>5955</b>	<b>218</b>	<b>218</b>	<b>8496</b>	<b>8416</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.