

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2021**  
**Fecha de Información: 20 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\$2536 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.00%<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	517,2	477,6	119,3	322,8	183,3	19,4	175
15-35	537,4	1018,4	594,5	99,0	44,9	59,4	379
36-60	43,2	25,7	5,0	0,0	20,7	43,2	0
61-90	11,9	13,8	0,0	0,0	3,8	1,9	10
91-180	170,9	66,6	0,0	70,0	36,6	70,9	30
>180	211,2	62,3	30,0	10,0	6,3	175,2	26
<b>Total</b>	<b>1491,8</b>	<b>1664,4</b>	<b>748,8</b>	<b>501,9</b>	<b>295,6</b>	<b>370,0</b>	<b>620</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	1.98%		0.81%	2.50%	1.53%
15-35	2.02%		1.94%	1.75%	1.95%
36-60	—		2.20%	1.99%	2.06%
61-90	2.18%		2.26%	2.20%	2.20%
91-180	2.43%		2.67%	2.47%	2.51%
>180	3.06%		2.76%	3.11%	3.05%
<b>Total</b>	<b>2.07%</b>		<b>1.68%</b>	<b>2.28%</b>	<b>2.00%</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	18 – 22 oct.				25 - 29 oct.				01 - 05 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	35	134	3438	3482	41	187	5252	6116	26	112	4048	3761
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	1460	1249	0	0	2844	2027	0	0	2137	2054
Otros <sup>c</sup>	133	35	678	815	187	41	1684	1542	112	26	464	791
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>5576</b>	<b>5546</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>9780</b>	<b>9685</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>6649</b>	<b>6606</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.