

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2021**  
**Fecha de Información: 22 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\$2389 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.13%<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	59,4	214,6	83,0	32,4	116,6	12,0	15
15-35	371,1	864,8	690,1	168,0	14,7	43,1	160
36-60	1,1	20,0	8,8	0,0	11,2	1,1	0
61-90	11,5	55,4	40,0	0,0	5,4	1,5	10
91-180	611,1	122,3	0,0	395,0	32,3	126,1	90
>180	301,3	199,2	25,0	128,0	6,2	5,3	168
<b>Total</b>	<b>1355,5</b>	<b>1476,3</b>	<b>846,9</b>	<b>723,4</b>	<b>186,4</b>	<b>189,1</b>	<b>443</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	2.18%		0.38%	1.58%	0.72%
15-35	2.25%		1.55%	2.14%	1.77%
36-60	—		2.36%	2.05%	2.34%
61-90	2.28%		2.37%	2.18%	2.35%
91-180	2.47%		2.62%	2.26%	2.31%
>180	3.45%		3.72%	3.46%	3.48%
<b>Total</b>	<b>2.75%</b>		<b>1.55%</b>	<b>2.40%</b>	<b>2.13%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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>	11	34	605	591	49	191	5444	6503	27	111	4151	3960
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	147	221	0	0	3033	2134	0	0	2230	2074
Otros <sup>c</sup>	34	11	233	157	191	49	1809	1555	111	27	497	801
<b>Total</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>985</b>	<b>969</b>	<b>240</b>	<b>240</b>	<b>10286</b>	<b>10192</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>6878</b>	<b>6835</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.