

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 27 de octubre de 2021**  
**Fecha de Información: 25 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\$3074 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.91%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragrupa y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	628,5	498,2	160,8	378,6	291,2	203,7	46,2
15-35	307,5	693,0	559,8	144,4	17,2	47,1	116,0
36-60	9,4	130,4	99,1	1,5	31,4	7,9	0,0
61-90	27,4	13,2	0,0	25,0	13,2	2,4	0,0
91-180	355,6	325,4	76,2	236,3	248,2	118,3	1,0
>180	216,9	42,6	20,0	10,0	11,6	195,9	11,0
<b>Total</b>	<b>1545,2</b>	<b>1702,9</b>	<b>915,9</b>	<b>795,7</b>	<b>612,8</b>	<b>575,3</b>	<b>174,2</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	2.31%		0.99%	1.16%	1.14%
15-35	2.29%		2.32%	1.58%	2.10%
36-60	-		1.58%	1.94%	1.61%
61-90	-		2.50%	2.29%	2.47%
91-180	2.30%		2.63%	2.37%	2.52%
>180	2.90%		3.48%	3.36%	3.35%
<b>Total</b>	<b>2.33%</b>		<b>1.86%</b>	<b>1.89%</b>	<b>1.91%</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	25 – 29 oct.				01 - 05 nov.				08 - 12 nov.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	55	193	5989	6886	26	111	4197	3994	44	151	3569	3492
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3132	2473	0	0	2258	2105	0	0	1872	1292
Otros <sup>c</sup>	192	55	2072	1740	111	26	498	810	151	44	436	1002
<b>Total</b>	<b>247</b>	<b>248</b>	<b>11193</b>	<b>11099</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>6953</b>	<b>6909</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>5877</b>	<b>5786</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.