

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2021**  
**Fecha de Información: 27 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\$3527 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.31%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	510,8	255,4	207,6	366,4	10,8	107,4	37,0
15-35	553,1	609,5	328,5	335,4	101,1	37,8	179,9
36-60	46,4	179,1	85,0	7,3	58,1	3,1	36,0
61-90	505,1	32,1	0,0	472,0	16,4	17,4	15,7
91-180	280,5	587,8	440,0	175,0	44,8	2,5	103,0
>180	86,8	295,5	245,0	40,0	7,5	3,8	43,0
<b>Total</b>	<b>1982,7</b>	<b>1959,3</b>	<b>1306,2</b>	<b>1396,1</b>	<b>238,5</b>	<b>172,1</b>	<b>414,6</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	2.56%	2.16%	1.70%	1.83%
15-35	2.42%	2.43%	1.83%	2.24%
36-60	2.40%	2.47%	2.49%	2.45%
61-90	2.42%	2.73%	2.41%	2.47%
91-180	2.75%	2.77%	2.71%	2.75%
>180	3.87%	3.84%	3.78%	3.84%
<b>Total</b>	<b>2.66%</b>	<b>2.55%</b>	<b>1.90%</b>	<b>2.31%</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>	36	154	4433	4647	81	113	4287	4262	50	153	3665	3661
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2192	2029	0	0	2499	2167	0	0	1964	1297
Otros <sup>c</sup>	154	36	1283	1141	113	81	500	813	153	50	447	1028
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>7908</b>	<b>7817</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>7286</b>	<b>7242</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>6076</b>	<b>5986</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.