

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 02 de noviembre de 2021**

**Fecha de Información: 28 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\$3317 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.56%<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	259,8	418,4	251,6	131,6	107,8	69,2	59,0
15-35	470,4	615,5	406,7	221,7	65,3	105,2	143,5
36-60	109,4	31,4	13,9	37,3	17,6	72,1	0,0
61-90	687,9	36,7	0,0	653,0	11,7	9,9	25,0
91-180	90,2	699,5	600,0	40,0	74,5	25,2	25,0
>180	114,0	94,4	30,4	50,0	6,0	6,0	58,0
<b>Total</b>	<b>1731,8</b>	<b>1896,0</b>	<b>1302,6</b>	<b>1133,6</b>	<b>283,0</b>	<b>287,7</b>	<b>310,5</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	2.43%	2.42%	1.93%	2.29%
15-35	2.53%	2.54%	2.37%	2.48%
36-60	—	2.51%	2.47%	2.48%
61-90	2.49%	2.83%	2.46%	2.51%
91-180	2.56%	2.87%	2.50%	2.69%
>180	3.73%	3.62%	3.89%	3.79%
<b>Total</b>	<b>2.74%</b>	<b>2.56%</b>	<b>2.46%</b>	<b>2.56%</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>	37	100	2157	2241	82	116	4335	4381	51	153	3695	3850
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1087	1026	0	0	2592	2173	0	0	2050	1315
Otros <sup>c</sup>	100	37	655	595	116	82	498	819	153	51	551	1041
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>3899</b>	<b>3862</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>7425</b>	<b>7373</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>6296</b>	<b>6206</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.