

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de enero de 2022**  
**Fecha de Información: 03 de enero de 2022<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\$2456 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.94%<sup>2</sup>.

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

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	868,4	412,6	94,1	540,2	9,9	19,6	308,6
15-35	501,1	1127,9	726,5	130,1	56,2	25,8	345,3
36-60	9,6	9,2	0,0	0,0	4,2	4,6	5,0
61-90	83,2	24,5	0,0	61,9	14,5	11,4	10,0
91-180	8,2	6,4	0,0	0,0	6,4	8,2	0,0
>180	5,7	68,2	60,0	0,0	8,2	5,7	0,0
<b>Total</b>	<b>1476,2</b>	<b>1648,8</b>	<b>880,6</b>	<b>732,1</b>	<b>99,3</b>	<b>75,3</b>	<b>668,8</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	4.10%		4.22%	3.28%	3.61%
15-35	4.11%		4.20%	4.04%	4.17%
36-60	4.20%		4.69%	3.72%	4.19%
61-90	4.22%		4.29%	3.94%	4.16%
91-180	-		4.52%	3.87%	4.15%
>180	-		4.93%	4.04%	4.56%
<b>Total</b>	<b>4.11%</b>		<b>4.22%</b>	<b>3.38%</b>	<b>3.94%</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	03 - 07 ene.				10 - 14 ene.				17 - 21 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	29	93	4111	5513	94	115	5368	7154	25	112	4407	4885
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4093	2638	0	0	4746	2156	0	0	2806	1557
Otros <sup>c</sup>	93	29	260	227	115	94	654	1286	112	25	1018	1736
<b>Total</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>8464</b>	<b>8378</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>10768</b>	<b>10596</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>8231</b>	<b>8178</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.