

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 07 de enero de 2022**  
**Fecha de Información: 05 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\$3356 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.81%<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	626,9	321,5	80,9	528,1	155,7	13,9	85
15-35	529,1	1372,7	1092,5	273,3	45,2	20,8	235
36-60	33,5	72,5	34,4	0,0	8,1	3,5	30
61-90	140,1	127,4	10,0	41,5	22,4	3,6	95
91-180	5,0	9,8	0,0	0,0	9,8	5,0	0
>180	468,4	153,9	85,0	275,0	8,9	133,4	60
<b>Total</b>	<b>1803,0</b>	<b>2057,9</b>	<b>1302,7</b>	<b>1117,9</b>	<b>250,1</b>	<b>180,1</b>	<b>505</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	4.55%	1.20%	3.34%	2.95%
15-35	4.50%	3.63%	4.36%	3.85%
36-60	4.46%	4.42%	4.06%	4.42%
61-90	4.39%	4.50%	3.69%	4.21%
91-180	—	4.71%	4.39%	4.60%
>180	4.76%	5.01%	4.36%	4.49%
<b>Total</b>	<b>4.52%</b>	<b>3.44%</b>	<b>3.94%</b>	<b>3.81%</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>	10	77	3276	3925	97	111	5525	7376	31	118	4528	5073
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2853	2153	0	0	4763	2223	0	0	2932	1618
Otros <sup>c</sup>	77	10	205	174	111	97	797	1298	118	31	1058	1758
<b>Total</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>6334</b>	<b>6252</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>11085</b>	<b>10897</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>8518</b>	<b>8449</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.