

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de enero de 2022**  
**Fecha de Información: 06 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\$2852 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.22%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	228,5	274,0	77,0	141,0	132,0	22,4	65,1
15-35	912,5	1159,8	792,2	555,5	37,6	26,9	330,0
36-60	62,6	47,3	0,0	0,0	7,3	22,6	40,0
61-90	45,6	51,8	0,0	15,0	21,8	0,6	30,0
91-180	207,3	97,9	0,0	10,0	27,9	127,3	70,0
>180	105,3	294,8	193,0	0,0	1,8	5,3	100,0
<b>Total</b>	<b>1561,7</b>	<b>1925,7</b>	<b>1062,2</b>	<b>721,5</b>	<b>228,4</b>	<b>205,1</b>	<b>635,1</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	4.62%	3.96%	3.70%	3.96%
15-35	4.56%	3.78%	4.26%	4.08%
36-60	4.52%	4.70%	4.57%	4.55%
61-90	4.54%	4.78%	4.48%	4.60%
91-180	4.50%	4.63%	4.58%	4.56%
>180	4.74%	4.91%	5.05%	4.85%
<b>Total</b>	<b>4.58%</b>	<b>4.04%</b>	<b>4.21%</b>	<b>4.22%</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>	7	51	2124	2582	97	111	5760	7579	31	118	4576	5159
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1796	1257	0	0	4788	2411	0	0	3017	1648
Otros <sup>c</sup>	51	7	137	141	111	97	930	1300	118	31	1060	1776
<b>Total</b>	<b>58</b>	<b>58</b>	<b>4057</b>	<b>3980</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>11478</b>	<b>11290</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>8653</b>	<b>8583</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.