

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de enero de 2022**  
**Fecha de Información: 07 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\$1660 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.45%<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	483,6	188,9	163,4	425,2	15,5	48,3	10,0
15-35	189,4	606,4	515,0	101,7	41,4	37,6	50,0
36-60	61,3	8,4	1,2	28,0	7,2	33,3	0,0
61-90	25,9	31,4	7,0	6,8	14,4	9,1	10,0
91-180	40,1	57,5	40,0	20,0	4,5	7,1	13,0
>180	6,5	48,9	28,2	0,0	15,2	1,0	5,5
<b>Total</b>	<b>806,8</b>	<b>941,5</b>	<b>754,8</b>	<b>581,7</b>	<b>98,2</b>	<b>136,5</b>	<b>88,5</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	4.62%	4.66%	4.09%	4.25%
15-35	4.79%	4.56%	4.52%	4.57%
36-60	—	4.82%	4.71%	4.73%
61-90	4.76%	4.91%	4.44%	4.74%
91-180	4.66%	4.60%	4.54%	4.59%
>180	5.14%	4.85%	4.73%	4.88%
<b>Total</b>	<b>4.77%</b>	<b>4.61%</b>	<b>4.23%</b>	<b>4.45%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge (365/\text{Plazo})}) - 1$ . 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>	2	25	332	513	103	124	6405	7718	34	121	4592	5262
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	361	137	0	0	4866	2953	0	0	3102	1649
Otros <sup>c</sup>	25	2	61	98	124	103	922	1334	121	34	1067	1781
<b>Total</b>	<b>27</b>	<b>27</b>	<b>754</b>	<b>748</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>12193</b>	<b>12005</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>8761</b>	<b>8692</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.