

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de enero de 2022**  
**Fecha de Información: 12 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\$5259 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.35%<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	1507,6	831,1	69,4	985,0	284,4	45,3	477,3
15-35	1046,1	2319,2	1458,8	240,9	124,0	68,9	736,4
36-60	44,0	68,4	10,0	0,0	48,4	34,0	10,0
61-90	313,4	177,1	90,0	84,3	47,1	189,1	40,0
91-180	32,0	105,5	45,0	25,0	60,5	7,0	0,0
>180	43,5	54,7	27,4	20,0	7,3	3,5	20,0
<b>Total</b>	<b>2986,6</b>	<b>3556,0</b>	<b>1700,5</b>	<b>1355,2</b>	<b>571,8</b>	<b>347,7</b>	<b>1283,7</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	3.90%	3.19%	Inf%	3.97%
15-35	4.90%	4.25%	4.84%	4.50%
36-60	4.86%	4.88%	4.94%	4.90%
61-90	4.79%	4.95%	4.57%	4.70%
91-180	—	4.90%	4.30%	4.85%
>180	4.89%	5.17%	4.91%	4.99%
<b>Total</b>	<b>4.53%</b>	<b>4.17%</b>	<b>4.45%</b>	<b>4.35%</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	10 – 14 ene.				17 - 21 ene.				24 - 28 ene.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	81	104	6967	7157	35	140	5226	5637	28	178	4822	4528
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4244	3825	0	0	3202	2090	0	0	2622	2017
Otros <sup>c</sup>	104	81	949	989	140	35	1176	1808	178	28	629	1463
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>12160</b>	<b>11971</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>9604</b>	<b>9535</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>8073</b>	<b>8008</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.