

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 17 de enero de 2022**  
**Fecha de Información: 13 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\$4487 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.60%<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	742,4	774,0	476,9	521,5	107,0	30,9	190,1
15-35	1034,9	1409,8	1125,5	787,0	117,1	0,0	247,8
36-60	30,4	105,1	39,2	0,0	65,8	0,0	30,4
61-90	319,6	224,3	116,2	254,0	63,2	0,0	65,6
91-180	18,3	79,1	0,0	0,0	77,1	0,0	18,3
>180	215,9	176,4	80,0	125,0	11,4	0,0	90,9
<b>Total</b>	<b>2361,5</b>	<b>2768,7</b>	<b>1837,8</b>	<b>1687,5</b>	<b>441,5</b>	<b>30,9</b>	<b>643,1</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	4.17%	4.19%	Inf%	4.35%
15-35	4.80%	4.65%	4.21%	4.55%
36-60	—	5.00%	4.61%	4.87%
61-90	4.91%	4.99%	4.89%	4.92%
91-180	5.00%	5.14%	4.72%	5.06%
>180	5.11%	5.11%	5.03%	5.07%
<b>Total</b>	<b>4.62%</b>	<b>4.64%</b>	<b>4.54%</b>	<b>4.60%</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>	57	54	5763	5735	46	151	5635	5827	28	189	4901	5085
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3272	3199	0	0	3246	2417	0	0	2929	2017
Otros <sup>c</sup>	54	57	851	861	151	46	1247	1814	189	28	802	1465
<b>Total</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>9886</b>	<b>9795</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>10128</b>	<b>10058</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>8632</b>	<b>8567</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.