

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 20 de enero de 2022**  
**Fecha de Información: 18 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\$3243 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.64%<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	688,9	462,4	201,2	467,2	160,3	120,7	101,0
15-35	1017,4	911,0	583,9	497,6	74,7	267,3	252,5
36-60	195,7	103,3	80,0	43,5	13,3	142,2	10,0
61-90	7,4	55,3	30,5	0,0	19,6	2,2	5,2
91-180	7,5	114,3	48,0	0,0	66,3	7,5	0,0
>180	47,4	15,8	0,0	10,0	0,8	22,4	15,0
<b>Total</b>	<b>1964,2</b>	<b>1662,2</b>	<b>943,5</b>	<b>1018,2</b>	<b>335,0</b>	<b>562,2</b>	<b>383,7</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	4.95%	3.82%	3.88%	4.01%
15-35	5.05%	4.83%	4.84%	4.88%
36-60	4.98%	5.02%	4.88%	4.93%
61-90	4.64%	5.14%	4.90%	5.02%
91-180	—	5.02%	4.72%	5.01%
>180	5.34%	5.38%	5.14%	5.21%
<b>Total</b>	<b>5.03%</b>	<b>4.65%</b>	<b>4.48%</b>	<b>4.64%</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	17 – 21 ene.				24 - 28 ene.				31 ene. - 04 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	63	163	6379	6686	32	189	5212	5336	24	108	5798	8262
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3448	2886	0	0	3024	2112	0	0	6239	3333
Otros <sup>c</sup>	163	63	1688	1852	189	32	819	1538	108	24	468	858
<b>Total</b>	<b>226</b>	<b>226</b>	<b>11515</b>	<b>11424</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>9055</b>	<b>8986</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>12505</b>	<b>12453</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.