

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 03 de febrero de 2022**  
**Fecha de Información: 01 de febrero 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\$2481 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.56%<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	415,9	341,1	222,3	238,9	22,8	81,0	96,0
15-35	719,0	721,8	364,9	420,3	72,4	14,1	284,5
36-60	91,7	132,0	0,0	58,2	102,0	3,4	30,0
61-90	130,4	177,3	70,0	70,0	52,3	5,4	55,0
91-180	26,3	71,8	5,1	25,0	66,7	1,3	0,0
>180	38,9	81,2	65,2	37,0	15,0	0,9	1,0
<b>Total</b>	<b>1422,3</b>	<b>1525,3</b>	<b>727,5</b>	<b>849,5</b>	<b>331,2</b>	<b>106,3</b>	<b>466,5</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	4.47%		4.79%	3.80%	4.10%
15-35	4.66%		4.45%	4.64%	4.57%
36-60	4.67%		4.83%	4.69%	4.78%
61-90	4.87%		5.01%	4.78%	4.94%
91-180	—		5.11%	4.79%	5.10%
>180	4.99%		5.46%	5.41%	5.43%
<b>Total</b>	<b>4.65%</b>		<b>4.71%</b>	<b>4.23%</b>	<b>4.56%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	31 ene. - 04 feb.				07 - 11 feb.				14 - 18 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	29	128	6921	8184	46	169	6335	7030	23	174	4624	6186
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	5876	4223	0	0	3938	2329	0	0	3948	1994
Otros <sup>c</sup>	128	29	467	790	169	46	537	1325	174	23	763	1083
<b>Total</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>13264</b>	<b>13197</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>10810</b>	<b>10684</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>9335</b>	<b>9263</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.