

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2022**  
**Fecha de Información: 14 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\$2971 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.07%<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         | 809,8                          | 392,2         | 250,5                               | 656,4         | 10,7          | 22,4         | 131,0              |
| 15-35        | 590,2                          | 981,9         | 695,5                               | 215,1         | 50,4          | 139,1        | 236,0              |
| 36-60        | 32,2                           | 45,3          | 0,0                                 | 10,0          | 25,3          | 2,2          | 20,0               |
| 61-90        | 119,1                          | 42,2          | 7,0                                 | 92,5          | 15,2          | 6,6          | 20,0               |
| 91-180       | 71,3                           | 87,5          | 32,7                                | 30,0          | 14,0          | 0,5          | 40,9               |
| >180         | 111,7                          | 180,6         | 123,0                               | 65,0          | 12,6          | 1,7          | 45,0               |
| <b>Total</b> | <b>1734,3</b>                  | <b>1729,8</b> | <b>1108,7</b>                       | <b>1069,0</b> | <b>128,3</b>  | <b>172,4</b> | <b>492,9</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         | 4.44%   | 3.72%                        | 3.05%        | 3.41%        |
| 15-35        | 4.45%   | 4.30%                        | 4.36%        | 4.35%        |
| 36-60        | 4.62%   | 4.82%                        | 4.18%        | 4.71%        |
| 61-90        | 5.14%   | 5.16%                        | 4.70%        | 5.09%        |
| 91-180       | 5.62%   | 5.70%                        | 5.47%        | 5.58%        |
| >180         | 6.02%   | 6.35%                        | 5.80%        | 6.14%        |
| <b>Total</b> | <b>4.72%</b>                                      | <b>4.27%</b>                 | <b>3.47%</b> | <b>4.07%</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                            | 14 – 18 feb. |            |              |              | 21 - 25 feb. |            |              |              | 28 feb. - 04 mar. |            |             |             |
|-------------------------------------|--------------|------------|--------------|--------------|--------------|------------|--------------|--------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
|                                     | Delivery     |            | NDF          |              | Delivery     |            | NDF          |              | Delivery          |            | NDF         |             |
|                                     | C            | V          | C            | V            | C            | V          | C            | V            | C                 | V          | C           | V           |
| Sector Financiero <sup>a</sup>      | 33           | 193        | 6976         | 8503         | 43           | 176        | 8674         | 8308         | 22                | 155        | 4015        | 5536        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 1            | 0          | 4937         | 3518         | 0            | 0          | 4935         | 4030         | 0                 | 0          | 3553        | 1851        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 192          | 33         | 1494         | 1272         | 176          | 43         | 905          | 2097         | 155               | 22         | 484         | 634         |
| <b>Total</b>                        | <b>226</b>   | <b>226</b> | <b>13407</b> | <b>13293</b> | <b>219</b>   | <b>219</b> | <b>14514</b> | <b>14435</b> | <b>177</b>        | <b>177</b> | <b>8052</b> | <b>8021</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.