

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 25 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\$3105 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.83%<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	616,2	571,8	194,0	488,5	326,9	76,7	51,0
15-35	636,0	665,7	403,9	418,7	97,3	52,8	164,5
36-60	111,2	60,6	10,0	56,2	50,5	54,9	0,1
61-90	21,0	72,8	10,8	0,0	51,5	10,5	10,5
91-180	260,7	120,1	17,5	30,0	89,1	217,2	13,5
>180	128,5	82,2	70,0	126,0	9,7	0,0	2,5
<b>Total</b>	<b>1773,6</b>	<b>1573,3</b>	<b>706,2</b>	<b>1119,4</b>	<b>624,9</b>	<b>412,0</b>	<b>242,1</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	4.13%		2.10%	3.21%	2.66%
15-35	4.20%		4.33%	4.02%	4.17%
36-60	4.44%		4.54%	4.40%	4.48%
61-90	4.42%		4.81%	4.41%	4.71%
91-180	5.09%		5.37%	4.85%	5.00%
>180	6.02%		6.25%	5.99%	6.12%
<b>Total</b>	<b>4.26%</b>		<b>3.52%</b>	<b>4.04%</b>	<b>3.83%</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	21 – 25 feb.				28 feb. - 04 mar.				07 - 11 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	20	54	1746	1802	32	153	5825	7183	73	158	6512	6541
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1030	793	1	0	4457	3159	0	0	3705	3065
Otros <sup>c</sup>	54	20	220	371	153	32	976	866	158	73	974	1231
<b>Total</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>2996</b>	<b>2966</b>	<b>186</b>	<b>185</b>	<b>11258</b>	<b>11208</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>11191</b>	<b>10837</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.