

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 07 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 03 de marzo 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\$3950 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.46%<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	528,6	226,7	61,2	385,8	38,5	15,9	127
15-35	653,4	1378,7	1059,3	415,7	91,4	9,7	228
36-60	27,3	150,8	0,0	2,0	150,8	25,3	0
61-90	509,2	138,2	9,2	455,0	84,0	9,2	45
91-180	220,3	289,6	18,2	167,0	221,4	3,3	50
>180	178,3	133,7	25,0	120,0	73,7	23,3	35
<b>Total</b>	<b>2117,2</b>	<b>2317,7</b>	<b>1172,8</b>	<b>1545,5</b>	<b>659,8</b>	<b>86,7</b>	<b>485</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	5.54%		3.75%	3.97%	4.33%
15-35	4.12%		4.00%	4.02%	4.02%
36-60	—		4.55%	3.89%	4.45%
61-90	4.54%		4.97%	4.53%	4.60%
91-180	4.95%		5.53%	4.63%	5.31%
>180	5.86%		6.04%	5.81%	5.90%
<b>Total</b>	<b>4.74%</b>		<b>4.42%</b>	<b>4.37%</b>	<b>4.46%</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	28 feb. - 04 mar.				07 - 11 mar.				14 - 18 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	18	58	2782	3260	77	179	7063	7355	21	241	6907	8495
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2167	1498	1	0	3998	3152	0	0	5448	3033
Otros <sup>c</sup>	58	18	273	415	178	77	1206	1405	241	21	1354	2075
<b>Total</b>	<b>76</b>	<b>76</b>	<b>5222</b>	<b>5173</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>12267</b>	<b>11912</b>	<b>262</b>	<b>262</b>	<b>13709</b>	<b>13603</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.