

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 09 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\$4349 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.53%<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	1024,1	413,2	172,0	794,9	77,2	65,2	164,0
15-35	806,5	1466,6	1154,0	518,8	51,8	27,0	260,8
36-60	90,4	70,1	0,0	45,0	70,1	45,4	0,0
61-90	505,1	66,5	20,0	500,0	46,5	5,1	0,0
91-180	109,6	115,9	4,8	60,0	100,7	39,2	10,4
>180	60,6	105,8	0,0	10,0	55,8	0,6	50,0
<b>Total</b>	<b>2596,3</b>	<b>2238,1</b>	<b>1350,8</b>	<b>1928,7</b>	<b>402,1</b>	<b>182,4</b>	<b>485,2</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	4.67%		2.81%	4.58%	3.94%
15-35	4.69%		4.56%	4.58%	4.59%
36-60	—		5.14%	4.24%	4.78%
61-90	—		5.50%	5.02%	5.42%
91-180	5.44%		5.94%	5.30%	5.69%
>180	6.85%		6.51%	6.79%	6.68%
<b>Total</b>	<b>4.92%</b>		<b>4.69%</b>	<b>4.25%</b>	<b>4.53%</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	07 – 11 mar.				14 - 18 mar.				21 - 25 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	81	149	6150	5638	30	260	8169	9738	49	188	3321	2911
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	2963	3011	0	0	5689	3883	0	0	1273	1444
Otros <sup>c</sup>	148	81	919	1026	260	30	2132	2213	188	49	684	869
<b>Total</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>10032</b>	<b>9675</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>15990</b>	<b>15834</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>5278</b>	<b>5224</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.