

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 10 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\$3222 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.45%<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	907,0	420,3	291,8	802,9	38,5	14,1	90,0
15-35	441,2	1065,2	908,7	220,5	32,4	96,5	124,1
36-60	20,8	8,7	0,0	0,0	8,7	20,8	0,0
61-90	54,7	98,3	31,0	0,0	47,3	34,7	20,0
91-180	280,7	143,3	70,0	244,6	43,3	6,1	30,0
>180	38,8	17,2	0,0	20,0	7,2	8,8	10,0
<b>Total</b>	<b>1743,2</b>	<b>1752,9</b>	<b>1301,5</b>	<b>1288,0</b>	<b>177,3</b>	<b>181,0</b>	<b>274,1</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.71%	4.22%	3.75%	3.97%
15-35	4.65%	4.37%	4.63%	4.47%
36-60	—	5.14%	4.80%	4.90%
61-90	4.95%	5.28%	5.29%	5.22%
91-180	5.37%	5.85%	5.34%	5.45%
>180	6.00%	6.25%	6.12%	6.11%
<b>Total</b>	<b>4.82%</b>	<b>4.48%</b>	<b>4.31%</b>	<b>4.45%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (365/\text{Plazo})) - 1$ . 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>	52	92	4453	3978	61	246	8550	9998	49	184	3494	3029
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2265	2634	0	0	5878	4231	0	0	1342	1507
Otros <sup>c</sup>	92	52	596	670	246	61	2178	2221	184	49	695	939
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>7314</b>	<b>7282</b>	<b>307</b>	<b>307</b>	<b>16606</b>	<b>16450</b>	<b>233</b>	<b>233</b>	<b>5531</b>	<b>5475</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.