

# 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 |              |              |
|--------------|---|--|------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas                                    |  | Compras                      | Ventas       | Total        |
| 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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{365/\text{Plazo}}}) - 1$ . 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.