

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 18 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 16 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\$1923 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.69%<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	401,8	438,6	248,2	331,3	128,7	8,8	61,7
15-35	336,5	468,6	314,0	112,3	10,9	80,5	143,7
36-60	70,0	21,4	7,8	13,0	13,5	57,1	0,0
61-90	13,3	30,7	12,9	0,3	17,8	13,1	0,0
91-180	154,1	71,0	39,0	54,0	11,9	80,1	20,0
>180	90,2	62,5	31,5	60,0	21,0	20,2	10,0
<b>Total</b>	<b>1066,0</b>	<b>1092,7</b>	<b>653,5</b>	<b>570,9</b>	<b>203,8</b>	<b>259,7</b>	<b>235,4</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	4.74%		4.53%	3.72%	4.21%
15-35	4.75%		4.68%	4.65%	4.70%
36-60	—		5.19%	4.85%	4.93%
61-90	—		5.47%	5.04%	5.29%
91-180	5.52%		5.93%	5.47%	5.53%
>180	6.79%		6.49%	6.22%	6.40%
<b>Total</b>	<b>4.90%</b>		<b>4.81%</b>	<b>4.49%</b>	<b>4.69%</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	14 – 18 mar.				21 - 25 mar.				28 mar. - 01 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	45	176	3950	4477	50	193	4442	4097	39	223	5175	5292
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2904	2186	0	0	1695	2135	0	0	2785	2807
Otros <sup>c</sup>	176	45	617	719	193	50	1111	962	223	39	971	779
<b>Total</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>7471</b>	<b>7382</b>	<b>243</b>	<b>243</b>	<b>7248</b>	<b>7194</b>	<b>262</b>	<b>262</b>	<b>8931</b>	<b>8878</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.