

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 17 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\$2885 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.66%<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	958,7	941,2	469,5	538,2	99,8	48,5	372,0
15-35	377,8	558,3	400,0	281,4	76,3	14,4	82,0
36-60	134,6	66,4	46,5	46,7	11,8	79,8	8,1
61-90	47,0	100,0	46,0	12,8	24,0	4,2	30,0
91-180	60,7	58,2	10,0	35,0	23,2	0,7	25,0
>180	74,7	34,5	10,0	60,0	14,5	4,7	10,0
<b>Total</b>	<b>1653,4</b>	<b>1758,6</b>	<b>982,0</b>	<b>974,0</b>	<b>249,6</b>	<b>152,3</b>	<b>527,1</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	4.68%	4.30%	72846.36%	4.44%
15-35	4.62%	4.73%	4.61%	4.68%
36-60	4.80%	5.04%	4.90%	4.91%
61-90	5.05%	5.59%	5.31%	5.29%
91-180	5.46%	5.99%	4.81%	5.40%
>180	6.27%	6.62%	6.66%	6.61%
<b>Total</b>	<b>4.76%</b>	<b>4.58%</b>	<b>4.70%</b>	<b>4.66%</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	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>	39	104	2825	3007	51	195	4578	4259	39	222	5242	5579
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1960	1671	0	0	1781	2236	0	0	3030	2836
Otros <sup>c</sup>	104	39	506	572	195	51	1187	992	222	39	991	794
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5291</b>	<b>5250</b>	<b>246</b>	<b>246</b>	<b>7546</b>	<b>7487</b>	<b>261</b>	<b>261</b>	<b>9263</b>	<b>9209</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.