

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 22 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\$2195 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.10%<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	281,8	424,9	194	69,1	107,4	89,2	123,5
15-35	885,9	590,1	112	568,4	179,2	18,6	298,9
36-60	87,3	52,0	0	20,0	44,7	60,0	7,3
61-90	44,7	29,3	0	0,2	29,3	44,5	0,0
91-180	20,6	106,2	45	0,0	61,2	20,6	0,0
>180	93,0	51,6	0	30,0	8,6	20,0	43,0
<b>Total</b>	<b>1413,3</b>	<b>1254,0</b>	<b>351</b>	<b>687,6</b>	<b>430,3</b>	<b>252,9</b>	<b>472,8</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	4.86%	4.93%	4.88%	4.89%
15-35	4.88%	4.95%	4.83%	4.88%
36-60	4.25%	5.25%	5.03%	5.07%
61-90	—	5.65%	5.20%	5.38%
91-180	—	6.08%	5.75%	6.01%
>180	6.96%	6.88%	6.81%	6.88%
<b>Total</b>	<b>5.05%</b>	<b>5.17%</b>	<b>5.08%</b>	<b>5.10%</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	21 – 25 mar.				28 mar. - 01 abr.				04 - 08 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	58	200	4791	4592	39	225	5468	5803	28	198	5552	6291
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2008	2296	0	0	3094	2896	0	0	4264	2997
Otros <sup>c</sup>	200	58	1209	1053	225	39	1080	883	198	28	522	999
<b>Total</b>	<b>258</b>	<b>258</b>	<b>8008</b>	<b>7941</b>	<b>264</b>	<b>264</b>	<b>9642</b>	<b>9582</b>	<b>226</b>	<b>226</b>	<b>10338</b>	<b>10287</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.