

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 28 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\$2152 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.38%<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	285,4	378,9	349,9	206,5	17,0	66,9	12,0
15-35	422,7	295,4	191,8	373,1	84,5	30,6	19,1
36-60	197,8	285,4	130,0	38,0	15,4	19,8	140,0
61-90	70,8	49,0	0,0	0,0	9,0	30,8	40,0
91-180	161,0	66,6	0,0	133,7	39,6	0,2	27,0
>180	173,9	148,5	0,0	0,0	3,5	28,9	145,0
<b>Total</b>	<b>1311,6</b>	<b>1223,8</b>	<b>671,7</b>	<b>751,3</b>	<b>169,1</b>	<b>177,2</b>	<b>383,1</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	4.13%	4.73%	4.74%	4.72%
15-35	4.85%	4.43%	4.75%	4.59%
36-60	5.07%	5.17%	5.04%	5.07%
61-90	20.86%	5.47%	5.28%	13.11%
91-180	5.52%	6.16%	4.71%	5.33%
>180	6.33%	6.88%	6.48%	6.37%
<b>Total</b>	<b>7.19%</b>	<b>4.75%</b>	<b>4.87%</b>	<b>5.38%</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	28 mar. - 01 abr.				04 - 08 abr.				11 - 15 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	48	229	5826	6581	31	210	6178	6568	14	132	3656	4398
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3566	3068	0	0	4476	3365	1	0	3090	2039
Otros <sup>c</sup>	229	48	1261	945	210	31	536	1208	131	14	486	775
<b>Total</b>	<b>277</b>	<b>277</b>	<b>10653</b>	<b>10594</b>	<b>241</b>	<b>241</b>	<b>11190</b>	<b>11141</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>7232</b>	<b>7212</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.