

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 29 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\$4378 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.31%<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	257,2	507,1	219,2	64,1	206,8	111,9	81,2
15-35	707,1	950,8	565,9	390,6	121,0	52,6	263,9
36-60	433,0	573,6	285,0	0,0	33,6	178,0	255,0
61-90	29,8	40,4	10,1	9,0	10,3	0,8	20,0
91-180	194,1	921,1	0,0	180,0	911,1	4,1	10,0
>180	386,7	7,2	0,2	380,0	7,0	6,7	0,0
<b>Total</b>	<b>2007,9</b>	<b>3000,3</b>	<b>1080,4</b>	<b>1023,7</b>	<b>1289,8</b>	<b>354,1</b>	<b>630,1</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	4.89%	4.83%	4.13%	4.64%
15-35	4.84%	3.34%	4.75%	4.02%
36-60	5.06%	5.11%	4.99%	5.04%
61-90	36.72%	5.64%	4.81%	25.60%
91-180	5.90%	6.39%	5.69%	6.38%
>180	—	6.55%	5.99%	6.00%
<b>Total</b>	<b>5.96%</b>	<b>5.15%</b>	<b>5.18%</b>	<b>5.31%</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>	43	187	5624	6353	36	213	6236	6746	17	165	3664	4407
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3664	2979	0	0	4533	3379	1	0	3090	2039
Otros <sup>c</sup>	187	43	1067	968	213	36	617	1210	164	17	487	775
<b>Total</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>10355</b>	<b>10300</b>	<b>249</b>	<b>249</b>	<b>11386</b>	<b>11335</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>7241</b>	<b>7221</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.