

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de abril de 2022**  
**Fecha de Información: 06 de abril 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\$3096 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.42%<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	625,8	370,8	223,7	510,1	55,4	23,9	91,7
15-35	854,8	1415,6	735,1	175,2	75,4	74,5	605,1
36-60	86,5	25,3	0,0	7,2	5,3	59,2	20,0
61-90	40,8	141,5	95,6	22,6	30,9	3,2	15,0
91-180	2,3	46,0	20,0	0,0	26,0	2,3	0,0
>180	147,4	161,2	50,4	55,0	20,8	2,4	90,0
<b>Total</b>	<b>1757,7</b>	<b>2160,5</b>	<b>1124,8</b>	<b>770,2</b>	<b>213,8</b>	<b>165,7</b>	<b>821,8</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.42%		5.35%	5.15%	5.26%
15-35	5.43%		5.36%	8.35%	5.38%
36-60	5.51%		5.39%	5.30%	5.36%
61-90	5.37%		5.45%	5.27%	5.43%
91-180	—		6.00%	5.68%	5.97%
>180	6.35%		6.22%	6.21%	6.29%
<b>Total</b>	<b>5.53%</b>		<b>5.42%</b>	<b>5.27%</b>	<b>5.42%</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	04 – 08 abr.				11 - 15 abr.				18 - 22 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	41	142	5213	5388	33	169	4355	5418	85	253	5328	4807
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3427	3139	1	0	3397	2470	10	0	2366	2462
Otros <sup>c</sup>	142	41	627	676	168	33	998	840	242	85	983	1289
<b>Total</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>9267</b>	<b>9203</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>8750</b>	<b>8728</b>	<b>337</b>	<b>338</b>	<b>8677</b>	<b>8558</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.