

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de abril de 2022**  
**Fecha de Información: 07 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\$2731 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.83%<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	513,1	328,7	128,0	452,3	162,7	22,8	38,0
15-35	530,4	1091,2	788,2	118,5	60,0	168,9	243,0
36-60	176,1	20,6	0,0	0,0	10,6	166,1	10,0
61-90	132,1	52,6	1,2	83,8	6,4	3,3	45,0
91-180	1,1	51,0	40,0	0,0	11,0	1,1	0,0
>180	136,3	104,4	30,0	62,0	3,8	3,7	70,5
<b>Total</b>	<b>1489,2</b>	<b>1648,5</b>	<b>987,5</b>	<b>716,6</b>	<b>254,5</b>	<b>366,0</b>	<b>406,5</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	5.37%		3.00%	4.07%	3.66%
15-35	5.41%		5.27%	5.30%	5.31%
36-60	5.35%		5.86%	4.17%	4.32%
61-90	5.37%		5.64%	5.37%	5.38%
91-180	—		6.04%	5.23%	5.97%
>180	6.28%		6.10%	6.16%	6.20%
<b>Total</b>	<b>5.55%</b>		<b>4.63%</b>	<b>4.72%</b>	<b>4.83%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/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>	34	101	3647	3819	33	170	4647	5453	89	254	5392	5354
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2592	2407	1	0	3410	2737	10	0	2721	2462
Otros <sup>c</sup>	101	34	363	349	169	33	999	844	244	89	1143	1306
<b>Total</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>6602</b>	<b>6575</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>9056</b>	<b>9034</b>	<b>343</b>	<b>343</b>	<b>9256</b>	<b>9122</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.