

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de abril de 2022**  
**Fecha de Información: 13 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\$2623 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.50%<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	699,2	481,8	351,4	573,0	21,3	17,3	109,0
15-35	545,0	891,3	676,3	350,7	23,2	2,5	191,8
36-60	1,8	31,0	17,9	0,0	13,1	1,8	0,0
61-90	142,9	43,8	27,1	140,0	16,7	2,9	0,0
91-180	36,7	35,4	13,0	30,0	22,4	6,7	0,0
>180	0,0	14,5	10,0	0,0	4,5	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>1425,7</b>	<b>1497,8</b>	<b>1095,8</b>	<b>1093,7</b>	<b>101,3</b>	<b>31,2</b>	<b>300,8</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	5.65%		4.74%	3.53%	4.10%
15-35	5.62%		4.43%	4.98%	4.75%
36-60	—		5.71%	5.43%	5.67%
61-90	—		5.80%	4.08%	4.29%
91-180	—		5.99%	5.62%	5.79%
>180	—		6.20%	5.21%	6.19%
<b>Total</b>	<b>5.63%</b>		<b>4.63%</b>	<b>4.02%</b>	<b>4.50%</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	11 – 15 abr.				18 - 22 abr.				25 - 29 abr.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	13	59	694	710	113	263	6128	5995	61	274	5624	5775
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	389	407	10	0	3110	2984	0	0	3085	2947
Otros <sup>c</sup>	58	13	108	58	253	113	1222	1347	274	61	969	871
<b>Total</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>1191</b>	<b>1175</b>	<b>376</b>	<b>376</b>	<b>10460</b>	<b>10326</b>	<b>335</b>	<b>335</b>	<b>9678</b>	<b>9593</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.