

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2022**  
**Fecha de Información: 11 de febrero 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\$2544 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.58%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	431,3	726,1	162,5	92,1	283,1	58,6	280,5
15-35	743,1	603,9	248,2	284,7	93,9	196,6	261,8
36-60	55,4	29,6	7,7	47,5	17,5	3,4	4,5
61-90	73,7	74,0	0,0	15,0	19,0	3,7	55,0
91-180	251,0	181,4	23,4	50,0	48,0	91,0	110,0
>180	66,2	59,7	17,0	25,0	2,7	1,2	40,0
<b>Total</b>	<b>1620,6</b>	<b>1674,7</b>	<b>458,8</b>	<b>514,3</b>	<b>464,2</b>	<b>354,6</b>	<b>751,8</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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	4.58%		4.12%	2.92%	4.06%
15-35	4.55%		4.39%	4.55%	4.49%
36-60	4.82%		5.06%	4.81%	5.00%
61-90	5.22%		5.39%	5.28%	5.27%
91-180	5.41%		5.96%	5.41%	5.50%
>180	6.20%		6.35%	5.89%	6.13%
<b>Total</b>	<b>4.83%</b>		<b>4.45%</b>	<b>4.45%</b>	<b>4.58%</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	07 – 11 feb.				14 - 18 feb.				21 - 25 feb.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	18	53	549	691	32	189	6495	8313	55	176	8388	8017
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	371	264	0	0	4777	3064	0	0	4732	3857
Otros <sup>c</sup>	53	18	153	94	189	32	1492	1272	176	55	897	2084
<b>Total</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>1073</b>	<b>1049</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>12764</b>	<b>12649</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>14017</b>	<b>13958</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.