

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2022**  
**Fecha de Información: 11 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\$3062 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.77%<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	740,0	401,5	187,8	666,6	183,2	42,9	30,5
15-35	631,9	589,4	473,8	437,2	14,6	93,7	101,0
36-60	254,8	53,8	2,0	50,0	51,8	204,8	0,0
61-90	63,0	29,6	0,0	40,0	9,6	3,0	20,0
91-180	115,2	273,2	197,5	45,0	75,7	70,2	0,0
>180	11,2	57,7	45,0	0,0	4,7	3,2	8,0
<b>Total</b>	<b>1816,1</b>	<b>1405,3</b>	<b>906,1</b>	<b>1238,8</b>	<b>339,7</b>	<b>417,8</b>	<b>159,5</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.75%	4.75%	3.75%	4.36%
15-35	4.77%	4.84%	4.65%	4.75%
36-60	–	4.65%	4.80%	4.77%
61-90	5.04%	5.23%	4.82%	5.08%
91-180	–	5.79%	5.45%	5.61%
>180	6.64%	6.31%	5.99%	6.34%
<b>Total</b>	<b>4.89%</b>	<b>4.97%</b>	<b>4.55%</b>	<b>4.77%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	07 – 11 mar.				14 - 18 mar.				21 - 25 mar.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	42	53	1789	1625	65	243	8912	10472	50	184	3944	3047
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	982	1117	0	0	6094	4465	0	0	1342	1941
Otros <sup>c</sup>	53	42	324	328	243	65	2354	2265	184	50	697	940
<b>Total</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>3095</b>	<b>3070</b>	<b>308</b>	<b>308</b>	<b>17360</b>	<b>17202</b>	<b>234</b>	<b>234</b>	<b>5983</b>	<b>5928</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.