

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de abril de 2022**  
**Fecha de Información: 31 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\$3243 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.93%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

| Rango        | Sector Financiero <sup>b</sup> |               | Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup> |              | Otros Agentes |              | Intermediarios del Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|--------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
|              | Compras                        | Ventas        | Compras                              | Ventas       | Compras       | Ventas       |                                      |
| 3-14         | 845,5                          | 809,5         | 218,9                                | 374,5        | 133,6         | 14,1         | 457                                  |
| 15-35        | 838,0                          | 938,4         | 482,0                                | 360,1        | 29,3          | 50,8         | 427                                  |
| 36-60        | 82,4                           | 60,3          | 0,0                                  | 0,0          | 60,3          | 82,4         | 0                                    |
| 61-90        | 146,4                          | 89,9          | 35,2                                 | 122,5        | 54,6          | 23,9         | 0                                    |
| 91-180       | 95,6                           | 155,7         | 105,0                                | 38,8         | 15,7          | 21,7         | 35                                   |
| >180         | 76,5                           | 32,4          | 19,0                                 | 55,2         | 5,4           | 13,3         | 8                                    |
| <b>Total</b> | <b>2084,4</b>                  | <b>2086,0</b> | <b>860,2</b>                         | <b>951,2</b> | <b>298,9</b>  | <b>206,2</b> | <b>927</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         | 3.79%   |  | 4.76%                        | 6.21%        | 4.68%        |
| 15-35        | 5.02%   |  | 4.91%                        | 4.81%        | 4.94%        |
| 36-60        | -   |  | 5.11%                        | 4.99%        | 5.04%        |
| 61-90        | -   |  | 5.45%                        | 5.27%        | 5.34%        |
| 91-180       | 5.55%   |  | 5.73%                        | 5.47%        | 5.58%        |
| >180         | 6.25%   |  | 6.64%                        | 6.35%        | 6.36%        |
| <b>Total</b> | <b>4.44%</b>                                      |  | <b>4.98%</b>                 | <b>5.50%</b> | <b>4.93%</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                            | 28 mar. - 01 abr. |           |             |             | 04 - 08 abr. |            |              |              | 11 - 15 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                | 73        | 3692        | 3873        | 37           | 216        | 6809         | 7392         | 23           | 166        | 3850        | 4581        |
| Intragrupo y off-shore <sup>b</sup> | 0                 | 0         | 2272        | 1938        | 0            | 0          | 4759         | 3642         | 1            | 0          | 3090        | 2111        |
| Otros <sup>c</sup>                  | 73                | 13        | 385         | 510         | 216          | 37         | 786          | 1242         | 165          | 23         | 551         | 776         |
| <b>Total</b>                        | <b>86</b>         | <b>86</b> | <b>6349</b> | <b>6321</b> | <b>253</b>   | <b>253</b> | <b>12354</b> | <b>12276</b> | <b>189</b>   | <b>189</b> | <b>7491</b> | <b>7468</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.