

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 07 de abril de 2022**  
**Fecha de Información: 05 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\$2781 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.09%<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	282,0	470,6	205,5	187,1	188,5	18,3	76,5
15-35	684,1	643,7	536,0	490,3	25,9	111,9	81,8
36-60	40,0	19,3	3,4	10,0	5,9	20,0	10,0
61-90	19,4	65,9	0,0	5,2	57,9	6,2	8,0
91-180	274,6	270,0	194,1	60,0	42,9	181,6	33,0
>180	148,5	92,7	50,0	120,7	22,7	7,8	20,0
<b>Total</b>	<b>1448,5</b>	<b>1562,2</b>	<b>989,1</b>	<b>873,4</b>	<b>343,9</b>	<b>345,8</b>	<b>229,3</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	5.26%		3.39%	5.50%	4.20%
15-35	5.23%		5.30%	5.13%	5.22%
36-60	5.30%		5.45%	9.31%	7.37%
61-90	5.37%		5.42%	4.21%	5.31%
91-180	5.43%		5.74%	5.36%	5.47%
>180	6.27%		6.21%	6.05%	6.18%
<b>Total</b>	<b>5.37%</b>		<b>4.73%</b>	<b>5.41%</b>	<b>5.09%</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	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>	49	181	6751	7383	30	168	4166	5315	85	252	5284	4577
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4786	3810	1	0	3307	2293	10	0	2190	2446
Otros <sup>c</sup>	181	49	741	1000	167	30	996	838	242	85	931	1264
<b>Total</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>12278</b>	<b>12193</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>8469</b>	<b>8446</b>	<b>337</b>	<b>337</b>	<b>8405</b>	<b>8287</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.