

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de mayo de 2022**  
**Fecha de Información: 02 de mayo 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\$4820 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.80%<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	395,9	934,3	402,0	307,7	474,3	30,2	58,0
15-35	917,4	1402,4	1182,8	624,9	18,3	91,1	201,3
36-60	395,9	179,6	38,3	90,6	11,4	175,3	130,0
61-90	44,2	5,7	0,0	18,6	5,7	25,6	0,0
91-180	764,9	135,4	58,0	400,0	34,4	321,9	43,0
>180	51,7	44,4	25,0	23,1	0,4	9,6	19,0
<b>Total</b>	<b>2569,9</b>	<b>2701,8</b>	<b>1706,0</b>	<b>1465,0</b>	<b>544,5</b>	<b>653,7</b>	<b>451,3</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.91%		4.95%	6.06%	5.27%
15-35	6.12%		6.02%	6.17%	6.09%
36-60	6.14%		6.29%	6.13%	6.14%
61-90	—		6.17%	5.99%	6.02%
91-180	6.06%		6.16%	5.89%	5.93%
>180	6.18%		6.24%	6.02%	6.10%
<b>Total</b>	<b>6.10%</b>		<b>5.47%</b>	<b>6.05%</b>	<b>5.80%</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	02 – 06 may.				09 - 13 may.				16 - 20 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	41	147	8619	9649	129	214	4153	4082	52	189	5961	5175
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	5428	3888	0	0	1953	1706	0	0	2865	2240
Otros <sup>c</sup>	147	41	1212	1647	214	129	696	889	189	52	527	1861
<b>Total</b>	<b>189</b>	<b>188</b>	<b>15259</b>	<b>15184</b>	<b>343</b>	<b>343</b>	<b>6802</b>	<b>6677</b>	<b>241</b>	<b>241</b>	<b>9353</b>	<b>9276</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.