

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2022**  
**Fecha de Información: 12 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\$2418 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.11%<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	297,4	492,4	310,6	182,8	88,7	21,4	93,2
15-35	767,0	687,9	412,7	337,3	22,2	176,6	253,0
36-60	54,2	11,5	0,0	19,5	5,8	28,9	5,7
61-90	100,5	59,9	25,0	60,0	4,9	10,5	30,0
91-180	83,1	148,1	60,0	10,0	28,1	13,1	60,0
>180	126,3	106,5	30,0	10,9	1,5	40,4	75,0
<b>Total</b>	<b>1428,5</b>	<b>1506,3</b>	<b>838,3</b>	<b>620,6</b>	<b>151,1</b>	<b>291,0</b>	<b>516,9</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	6.10%	5.78%	5.95%	5.89%
15-35	6.17%	6.26%	6.08%	6.16%
36-60	5.95%	6.16%	5.91%	5.95%
61-90	6.12%	6.10%	5.90%	6.05%
91-180	6.15%	6.31%	5.90%	6.16%
>180	6.67%	6.48%	6.19%	6.50%
<b>Total</b>	<b>6.22%</b>	<b>6.08%</b>	<b>6.04%</b>	<b>6.11%</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	09 – 13 may.				16 - 20 may.				23 - 27 may.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	49	92	1951	2022	64	256	7192	7007	54	339	6276	6841
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	736	477	0	0	3667	2725	0	0	4045	2541
Otros <sup>c</sup>	92	49	376	549	256	64	961	2011	339	54	633	1446
<b>Total</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>3063</b>	<b>3048</b>	<b>320</b>	<b>320</b>	<b>11820</b>	<b>11743</b>	<b>393</b>	<b>393</b>	<b>10954</b>	<b>10828</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.