

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2022**  
**Fecha de Información: 16 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\$2718 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.56%<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	199,7	821,7	274,1	45,3	441,6	48,4	106,0
15-35	458,9	534,2	378,0	297,5	39,1	44,3	117,1
36-60	390,7	111,6	0,0	87,8	106,6	297,9	5,0
61-90	157,1	17,3	0,0	31,8	17,3	125,3	0,0
91-180	165,4	123,8	45,0	75,4	28,0	39,2	50,7
>180	5,7	16,8	10,0	0,0	1,8	0,0	5,7
<b>Total</b>	<b>1377,6</b>	<b>1625,3</b>	<b>707,1</b>	<b>537,8</b>	<b>634,4</b>	<b>555,2</b>	<b>284,6</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	6.26%		3.73%	6.27%	4.40%
15-35	6.31%		6.39%	6.18%	6.29%
36-60	6.19%		6.32%	6.04%	6.11%
61-90	—		6.37%	6.00%	6.04%
91-180	6.34%		6.43%	6.35%	6.38%
>180	6.78%		6.87%	6.48%	6.77%
<b>Total</b>	<b>6.30%</b>		<b>4.85%</b>	<b>6.11%</b>	<b>5.56%</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	16 – 20 may.				23 - 27 may.				30 may. - 03 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	71	263	7549	8302	56	347	6464	7101	21	127	5031	5580
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4098	2851	0	0	4261	2675	0	0	3277	2132
Otros <sup>c</sup>	263	71	1635	2047	347	56	652	1472	127	21	627	1165
<b>Total</b>	<b>334</b>	<b>334</b>	<b>13282</b>	<b>13200</b>	<b>403</b>	<b>403</b>	<b>11377</b>	<b>11248</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>8935</b>	<b>8877</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.