

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2022**  
**Fecha de Información: 26 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\$4000 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.52%<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	776,6	259,2	144,8	668,4	27,4	21,2	87,0
15-35	1104,5	1318,6	894,0	774,7	150,5	55,6	274,1
36-60	58,3	52,3	20,0	30,1	22,9	18,8	9,3
61-90	19,7	150,7	110,0	2,0	30,7	7,7	10,0
91-180	297,6	252,5	96,3	180,0	61,2	22,6	95,0
>180	130,6	184,5	40,0	0,1	14,5	0,6	130,0
<b>Total</b>	<b>2387,2</b>	<b>2217,8</b>	<b>1305,2</b>	<b>1655,3</b>	<b>307,2</b>	<b>126,5</b>	<b>605,4</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	5.86%		5.76%	4.57%	4.88%
15-35	5.85%		5.47%	5.74%	5.61%
36-60	5.82%		5.78%	5.83%	5.81%
61-90	5.75%		6.05%	5.81%	5.97%
91-180	6.02%		6.28%	5.53%	5.90%
>180	6.67%		6.74%	6.47%	6.69%
<b>Total</b>	<b>6.05%</b>		<b>5.63%</b>	<b>5.15%</b>	<b>5.52%</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	23 – 27 may.				30 may. - 03 jun.				06 - 10 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	56	145	4123	4107	44	144	6807	7609	67	201	4690	4497
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2047	1934	0	0	3951	3379	0	0	2407	2338
Otros <sup>c</sup>	145	56	642	670	144	44	1517	1213	200	67	706	685
<b>Total</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>6812</b>	<b>6711</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>12275</b>	<b>12201</b>	<b>267</b>	<b>268</b>	<b>7803</b>	<b>7520</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.