

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de junio de 2022**  
**Fecha de Información: 27 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\$2558 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.38%<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	432,5	137,7	49,9	251,8	47,8	140,8	40,0
15-35	789,9	762,0	317,8	511,7	253,1	87,2	191,0
36-60	6,8	175,6	134,0	0,0	40,1	5,3	1,5
61-90	64,7	99,4	10,0	0,0	54,4	29,7	35,0
91-180	69,0	178,9	65,0	30,0	113,9	39,0	0,0
>180	63,0	91,6	30,0	15,0	15,8	2,2	45,8
<b>Total</b>	<b>1425,9</b>	<b>1445,1</b>	<b>606,8</b>	<b>808,5</b>	<b>525,0</b>	<b>304,1</b>	<b>313,3</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	5.68%		6.66%	4.02%	4.50%
15-35	5.64%		5.64%	5.35%	5.52%
36-60	5.65%		5.15%	5.54%	5.17%
61-90	5.70%		5.96%	5.64%	5.82%
91-180	—		5.90%	6.04%	5.94%
>180	6.72%		6.68%	6.67%	6.70%
<b>Total</b>	<b>5.81%</b>		<b>5.71%</b>	<b>4.89%</b>	<b>5.38%</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>	42	83	627	623	51	146	7072	7671	78	220	4745	4521
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	196	228	0	0	3988	3514	0	0	2415	2386
Otros <sup>c</sup>	83	42	231	191	146	51	1528	1330	219	78	723	692
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>1054</b>	<b>1042</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>12588</b>	<b>12515</b>	<b>297</b>	<b>298</b>	<b>7883</b>	<b>7599</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.