

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 30 de junio de 2022**  
**Fecha de Información: 28 de junio 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\$2905 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.82%<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	562,8	675,5	410,7	284,0	125,7	139,8	139,0
15-35	745,8	789,7	442,7	494,5	160,0	64,3	187,0
36-60	156,1	54,5	5,4	0,0	49,1	156,1	0,0
61-90	85,2	28,3	14,8	49,0	13,6	36,2	0,0
91-180	7,4	23,5	1,9	0,0	21,6	7,4	0,0
>180	45,2	102,1	56,5	0,0	4,6	0,0	45,2
<b>Total</b>	<b>1602,5</b>	<b>1673,6</b>	<b>932,0</b>	<b>827,5</b>	<b>374,6</b>	<b>403,8</b>	<b>371,2</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	6.01%	6.02%	4.78%	5.40%
15-35	6.02%	6.05%	5.79%	5.97%
36-60	—	6.15%	6.00%	6.03%
61-90	—	6.27%	6.11%	6.13%
91-180	—	6.47%	6.10%	6.37%
>180	6.79%	6.59%	6.44%	6.67%
<b>Total</b>	<b>6.10%</b>	<b>6.09%</b>	<b>5.46%</b>	<b>5.82%</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	27 jun. - 01 jul.				04 - 08 jul.				11 - 15 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	83	214	7963	8898	23	143	5072	4864	35	220	6141	5602
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	2	0	5182	4187	0	0	2565	2594	0	0	3333	2873
Otros <sup>c</sup>	211	83	1432	1232	143	23	575	674	219	35	846	1731
<b>Total</b>	<b>296</b>	<b>297</b>	<b>14577</b>	<b>14317</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>8212</b>	<b>8132</b>	<b>254</b>	<b>255</b>	<b>10320</b>	<b>10206</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.