

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de junio de 2022**  
**Fecha de Información: 29 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\$5767 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.81%<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 Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	737,1	727,5	117,2	500,8	429,1	55,1	181,2
15-35	973,3	1464,0	1159,9	611,3	73,3	131,2	230,8
36-60	145,7	25,5	0,0	0,0	25,5	145,7	0,0
61-90	683,2	155,1	70,0	215,4	24,9	407,6	60,2
91-180	505,6	822,8	661,8	332,0	16,0	28,6	145,0
>180	88,9	144,2	27,0	0,0	31,2	0,0	88,9
<b>Total</b>	<b>3133,7</b>	<b>3339,0</b>	<b>2035,9</b>	<b>1659,5</b>	<b>599,9</b>	<b>768,1</b>	<b>706,1</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	6.13%	4.43%	4.57%	4.81%
15-35	6.13%	6.14%	5.97%	6.10%
36-60	—	6.19%	6.09%	6.10%
61-90	6.24%	6.19%	5.95%	6.00%
91-180	6.28%	6.00%	6.18%	6.19%
>180	6.90%	6.74%	6.33%	6.83%
<b>Total</b>	<b>6.27%</b>	<b>5.61%</b>	<b>5.77%</b>	<b>5.81%</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>	141	148	6505	6823	27	144	5183	5354	39	220	6156	5752
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	4040	3329	0	0	2610	2647	0	0	3450	2883
Otros <sup>c</sup>	148	141	926	1093	144	27	979	692	219	39	876	1733
<b>Total</b>	<b>290</b>	<b>289</b>	<b>11471</b>	<b>11245</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>8772</b>	<b>8693</b>	<b>258</b>	<b>259</b>	<b>10482</b>	<b>10368</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.