

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 06 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 01 de julio 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\$1945 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.28%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	267,0	357,2	197,9	105,7	31,3	33,2	128
15-35	642,8	794,8	546,8	375,0	19,0	38,8	229
36-60	6,9	5,1	2,2	0,2	3,0	6,6	0
61-90	26,0	97,9	85,0	0,0	2,9	16,0	10
91-180	32,0	18,0	0,0	0,0	18,0	32,0	0
>180	25,9	38,4	35,0	10,0	3,4	15,9	0
<b>Total</b>	<b>1000,5</b>	<b>1311,4</b>	<b>866,8</b>	<b>491,0</b>	<b>77,6</b>	<b>142,5</b>	<b>367</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	6.57%	5.51%	5.93%	5.92%
15-35	6.56%	6.52%	6.10%	6.39%
36-60	—	6.69%	6.11%	6.28%
61-90	6.59%	6.59%	6.27%	6.52%
91-180	—	6.71%	6.43%	6.53%
>180	—	7.00%	6.37%	6.81%
<b>Total</b>	<b>6.56%</b>	<b>6.20%</b>	<b>6.13%</b>	<b>6.28%</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>	18	25	1657	1454	32	146	5427	5796	44	220	6288	6041
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	732	916	0	0	2748	2675	0	0	3608	2898
Otros <sup>c</sup>	25	18	219	152	146	32	1116	740	219	44	930	1754
<b>Total</b>	<b>43</b>	<b>43</b>	<b>2608</b>	<b>2522</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>9291</b>	<b>9211</b>	<b>263</b>	<b>264</b>	<b>10826</b>	<b>10693</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.