

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 07 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 05 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\$2662 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.11%<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	289,5	831,9	328,4	135,4	373,9	24,6	129,6
15-35	622,8	514,8	298,2	352,8	19,6	73,0	197,0
36-60	374,0	33,8	10,6	4,7	23,2	369,3	0,0
61-90	22,7	13,4	6,9	0,0	6,5	22,7	0,0
91-180	172,6	173,6	20,9	0,0	42,7	62,6	110,0
>180	32,5	49,3	30,0	0,0	9,3	0,0	32,5
<b>Total</b>	<b>1514,1</b>	<b>1616,8</b>	<b>695,0</b>	<b>492,9</b>	<b>475,2</b>	<b>552,1</b>	<b>469,1</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.61%		4.88%	6.26%	5.45%
15-35	6.61%		6.66%	6.48%	6.59%
36-60	—		6.62%	6.16%	6.19%
61-90	—		6.92%	6.31%	6.45%
91-180	6.56%		6.65%	6.45%	6.55%
>180	6.91%		6.88%	6.97%	6.94%
<b>Total</b>	<b>6.60%</b>		<b>5.68%</b>	<b>6.30%</b>	<b>6.11%</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	04 – 08 jul.				11 - 15 jul.				18 - 22 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	35	147	5702	6087	46	220	6328	6541	35	182	3819	4146
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	2934	2929	0	0	3736	2905	0	0	2629	1588
Otros <sup>c</sup>	147	35	1203	744	220	46	1298	1764	182	35	494	1172
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>9839</b>	<b>9760</b>	<b>266</b>	<b>266</b>	<b>11362</b>	<b>11210</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>6942</b>	<b>6906</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.