

# 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 Mercado Cambiario |
|--------------|--------------------------------|---------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|--------------------------------------|
|              | Compras                        | Ventas        | Compras                             | Ventas       | Compras       | Ventas       |                                      |
| 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 |              | Total        |
|--------------|---|------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas                                    | Compras                      | Ventas       |              |
| 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.