# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de junio de 2022**
**Fecha de Información: 23 de junio de 2022**[1]

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$4174 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.47%[2].

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados[a]

| | Sector Financiero[b] | | Intragrupo y Off-shore[c] | | Otros Agentes | | Intermediarios del |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Rango | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Mercado Cambiario |
| 3-14 | 422,4 | 495,0 | 375,7 | 251,7 | 16,3 | 67,8 | 103,0 |
| 15-35 | 1235,2 | 1252,6 | 939,9 | 846,6 | 14,1 | 90,0 | 298,6 |
| 36-60 | 213,4 | 21,7 | 0,0 | 182,4 | 8,7 | 18,0 | 13,0 |
| 61-90 | 78,3 | 228,5 | 199,6 | 60,0 | 18,9 | 8,3 | 10,0 |
| 91-180 | 87,9 | 278,3 | 245,0 | 40,0 | 8,3 | 22,9 | 25,0 |
| >180 | 184,6 | 179,8 | 120,0 | 119,8 | 5,8 | 10,8 | 54,0 |
| **Total** | **2221,7** | **2455,8** | **1880,2** | **1500,5** | **72,1** | **217,6** | **503,6** |

[a] Cifras en millones de dólares
[b] Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes
[c] Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| | Intermediarios del Mercado Cambiario [a] | Otros Agentes sin intragrupo | | |
|---|---|---|---|---|
| Rango | Compras/Ventas | Compras | Ventas | Total |
| 3-14 | 5.95% | 5.99% | 4.98% | 5.61% |
| 15-35 | 5.97% | 5.15% | 4.82% | 5.20% |
| 36-60 | 5.83% | 6.07% | 5.71% | 5.82% |
| 61-90 | 5.89% | 6.11% | 5.54% | 5.92% |
| 91-180 | 6.24% | 6.45% | 6.04% | 6.15% |
| >180 | 6.71% | 6.72% | 6.55% | 6.64% |
| **Total** | **6.06%** | **5.46%** | **5.14%** | **5.47%** |

[a] 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.

[1] 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.

[2] 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

¨Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| | 20 – 24 jun. | | | | 27 jun. - 01 jul. | | | | 04 - 08 jul. | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| Sectores | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero[a] | 24 | 105 | 3600 | 4035 | 75 | 202 | 7108 | 7891 | 15 | 141 | 4895 | 4689 |
| Intragrupo y off-shore[b] | 1 | 0 | 2230 | 1781 | 2 | 0 | 4566 | 3684 | 0 | 0 | 2521 | 2547 |
| Otros[c] | 104 | 24 | 559 | 507 | 200 | 75 | 1196 | 1035 | 141 | 15 | 563 | 665 |
| **Total** | **129** | **129** | **6389** | **6323** | **277** | **277** | **12870** | **12610** | **156** | **156** | **7979** | **7901** |

[a] Cifras en millones de dólares.
[b] Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes
[c] Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.