# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 05 de julio de 2022**
**Fecha de Información: 30 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$2466 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.35%[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 | 204,4 | 357,3 | 122,4 | 84,0 | 160,9 | 46,4 | 74,0 |
| 15-35 | 550,9 | 710,7 | 611,9 | 446,9 | 55,7 | 61,0 | 43,0 |
| 36-60 | 145,5 | 10,6 | 0,0 | 2,2 | 10,6 | 143,3 | 0,0 |
| 61-90 | 67,3 | 142,3 | 124,3 | 20,0 | 7,9 | 37,3 | 10,0 |
| 91-180 | 64,7 | 343,9 | 270,0 | 13,0 | 28,9 | 6,7 | 45,0 |
| >180 | 16,1 | 40,5 | 35,7 | 0,0 | 4,8 | 0,0 | 16,1 |
| **Total** | **1048,8** | **1605,2** | **1164,3** | **566,2** | **268,9** | **294,6** | **188,1** |

[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 | 6.41% | 6.40% | 6.05% | 6.29% |
| 15-35 | 6.38% | 6.44% | 6.21% | 6.36% |
| 36-60 | – | 6.38% | 6.24% | 6.25% |
| 61-90 | 6.39% | 6.41% | 6.21% | 6.30% |
| 91-180 | 6.42% | 6.44% | 6.17% | 6.42% |
| >180 | – | 6.72% | 6.51% | 6.66% |
| **Total** | **6.40%** | **6.44%** | **6.19%** | **6.35%** |

[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

| | 27 jun. - 01 jul. | | | | 04 - 08 jul. | | | | 11 - 15 jul. | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| Sectores | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero[a] | 40 | 82 | 4673 | 5064 | 29 | 145 | 5250 | 5574 | 41 | 219 | 6246 | 5930 |
| Intragrupo y off-shore[b] | 0 | 0 | 3236 | 2588 | 0 | 0 | 2661 | 2647 | 0 | 0 | 3535 | 2898 |
| Otros[c] | 82 | 40 | 505 | 569 | 144 | 29 | 1112 | 722 | 219 | 41 | 904 | 1744 |
| **Total** | **122** | **122** | **8414** | **8221** | **173** | **174** | **9023** | **8943** | **260** | **260** | **10685** | **10572** |

[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.