

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 10 de junio de 2022**  
**Fecha de Información: 08 de junio 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\$4866 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.04%<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	924,8	805,5	335,4	541,0	102,1	15,8	368,0
15-35	876,6	1302,0	992,2	518,3	18,1	66,6	291,7
36-60	69,9	88,7	60,0	5,7	28,7	64,3	0,0
61-90	585,7	153,7	0,0	450,0	18,7	0,7	135,0
91-180	302,6	444,2	190,0	136,4	94,2	6,2	160,0
>180	129,3	172,6	128,0	90,0	9,6	4,3	35,0
<b>Total</b>	<b>2888,9</b>	<b>2966,7</b>	<b>1705,6</b>	<b>1741,4</b>	<b>271,3</b>	<b>157,9</b>	<b>989,7</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	6.41%		5.65%	5.56%	5.95%
15-35	6.15%		5.88%	6.08%	5.99%
36-60	-		6.16%	6.05%	6.11%
61-90	6.02%		6.39%	5.80%	5.87%
91-180	6.39%		6.56%	6.42%	6.45%
>180	6.89%		6.88%	6.72%	6.86%
<b>Total</b>	<b>6.30%</b>		<b>5.97%</b>	<b>5.91%</b>	<b>6.04%</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	06 – 10 jun.				13 - 17 jun.				20 - 24 jun.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	80	164	4940	4994	52	227	9844	10919	30	202	4445	4807
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3014	2786	1	0	6029	4849	0	0	2535	1871
Otros <sup>c</sup>	163	80	617	530	226	52	2140	2065	202	30	668	878
<b>Total</b>	<b>243</b>	<b>244</b>	<b>8571</b>	<b>8310</b>	<b>279</b>	<b>279</b>	<b>18013</b>	<b>17833</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>7648</b>	<b>7556</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.