

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 12 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 08 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\$2875 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.70%<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	580,7	294,3	125,5	374,1	60,7	98,5	108
15-35	1022,3	1211,4	589,5	350,0	99,9	150,3	522
36-60	61,2	7,8	0,0	0,0	7,8	61,2	0
61-90	146,6	61,8	0,0	65,4	16,8	36,2	45
91-180	22,7	47,4	0,0	0,0	27,4	2,7	20
>180	25,6	96,5	85,2	15,0	3,3	2,6	8
<b>Total</b>	<b>1859,1</b>	<b>1719,3</b>	<b>800,2</b>	<b>804,6</b>	<b>216,0</b>	<b>351,5</b>	<b>703</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	5.88%	5.07%	5.60%	5.52%
15-35	5.93%	5.48%	5.46%	5.64%
36-60	—	6.43%	6.00%	6.05%
61-90	6.26%	6.19%	6.18%	6.21%
91-180	6.24%	6.59%	6.12%	6.43%
>180	6.42%	6.78%	5.59%	6.62%
<b>Total</b>	<b>5.96%</b>	<b>5.56%</b>	<b>5.63%</b>	<b>5.70%</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>	11	35	448	409	110	222	7308	7706	40	183	4004	4345
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	201	212	0	0	3951	3574	0	0	2723	1653
Otros <sup>c</sup>	35	11	86	106	221	110	2093	1915	183	40	538	1231
<b>Total</b>	<b>46</b>	<b>46</b>	<b>735</b>	<b>727</b>	<b>331</b>	<b>332</b>	<b>13352</b>	<b>13195</b>	<b>223</b>	<b>223</b>	<b>7265</b>	<b>7229</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.