

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 14 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 12 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\$2899 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.99%<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
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	400,3	711,4	89,5	191,8	506,9	93,6	115,0
15-35	847,8	590,4	175,2	338,7	148,2	242,1	266,9
36-60	86,4	17,0	0,0	5,0	12,8	77,2	4,2
61-90	57,4	37,4	8,8	13,3	8,6	24,1	20,0
91-180	186,7	125,4	100,0	0,0	25,4	186,7	0,0
>180	131,7	143,7	109,0	10,8	4,7	91,0	30,0
<b>Total</b>	<b>1710,3</b>	<b>1625,2</b>	<b>482,6</b>	<b>559,5</b>	<b>706,6</b>	<b>714,8</b>	<b>436,1</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	5.01%		4.18%	3.32%	4.02%
15-35	5.07%		5.16%	5.02%	5.07%
36-60	4.89%		5.81%	5.29%	5.34%
61-90	5.80%		6.09%	5.72%	5.80%
91-180	—		5.66%	5.76%	5.72%
>180	6.68%		7.15%	6.90%	6.99%
<b>Total</b>	<b>5.20%</b>		<b>4.95%</b>	<b>4.96%</b>	<b>4.99%</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: ((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

Sectores	11 – 15 jul.				18 - 22 jul.				25 - 29 jul.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	47	159	6375	6797	45	187	4247	5023	33	240	6404	6754
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3187	3035	0	0	2845	1793	0	0	4129	2796
Otros <sup>c</sup>	158	47	2124	1733	187	45	1038	1278	240	33	866	1800
<b>Total</b>	<b>205</b>	<b>206</b>	<b>11686</b>	<b>11565</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>8130</b>	<b>8094</b>	<b>273</b>	<b>273</b>	<b>11399</b>	<b>11350</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.