

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 19 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 15 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\$2306 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.45%<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	309,6	456,0	286,2	260,8	151,9	30,8	18,0
15-35	538,7	792,2	494,5	300,0	63,1	4,1	234,6
36-60	132,9	12,8	0,0	0,0	12,8	132,9	0,0
61-90	212,1	90,5	10,0	150,0	20,5	2,1	60,0
91-180	21,6	18,9	0,0	10,0	18,9	11,6	0,0
>180	25,5	7,5	0,0	24,2	7,5	1,3	0,0
<b>Total</b>	<b>1240,4</b>	<b>1377,9</b>	<b>790,7</b>	<b>745,0</b>	<b>274,6</b>	<b>182,7</b>	<b>312,6</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	5.82%		5.84%	5.50%	5.65%
15-35	5.92%		5.24%	4.29%	5.13%
36-60	—		6.42%	5.90%	5.95%
61-90	6.44%		6.24%	6.06%	6.38%
91-180	—		6.77%	6.36%	6.55%
>180	—		7.51%	7.58%	7.56%
<b>Total</b>	<b>6.02%</b>		<b>5.48%</b>	<b>5.17%</b>	<b>5.45%</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>	9	65	863	1178	50	198	5090	5865	35	262	6830	7168
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	469	328	0	0	2961	2339	0	0	4298	2982
Otros <sup>c</sup>	65	9	571	393	198	50	1504	1315	262	35	923	1840
<b>Total</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>1903</b>	<b>1899</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>9555</b>	<b>9519</b>	<b>297</b>	<b>297</b>	<b>12051</b>	<b>11990</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.