

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 21 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 18 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\$3241 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.56%<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	261,6	445,7	146,1	161,4	234,6	35,2	65,0
15-35	941,1	1059,5	634,6	569,7	69,4	15,9	355,5
36-60	8,7	16,8	0,0	0,0	16,8	8,7	0,0
61-90	43,2	207,9	180,5	30,0	27,5	13,2	0,0
91-180	273,1	203,7	100,7	0,0	33,1	203,1	70,0
>180	123,4	166,8	129,7	101,1	17,1	2,3	20,0
<b>Total</b>	<b>1651,0</b>	<b>2100,4</b>	<b>1191,5</b>	<b>862,2</b>	<b>398,5</b>	<b>278,3</b>	<b>510,5</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	6.18%		2.62%	5.84%	3.97%
15-35	6.01%		5.96%	5.86%	5.97%
36-60	—		6.66%	6.02%	6.44%
61-90	—		6.70%	6.39%	6.62%
91-180	6.61%		6.93%	6.29%	6.44%
>180	7.10%		7.53%	7.43%	7.33%
<b>Total</b>	<b>6.16%</b>		<b>4.89%</b>	<b>6.08%</b>	<b>5.56%</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	18 – 22 jul.				25 - 29 jul.				01 - 05 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	52	201	5399	6184	36	267	6932	7233	30	136	6140	6182
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3010	2487	0	0	4324	3041	0	0	4048	3254
Otros <sup>c</sup>	201	52	1702	1403	267	36	952	1869	136	30	291	1008
<b>Total</b>	<b>253</b>	<b>253</b>	<b>10111</b>	<b>10074</b>	<b>303</b>	<b>303</b>	<b>12208</b>	<b>12143</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>10479</b>	<b>10444</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.