

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 26 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 22 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\$3015 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.22%<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	235,5	351,5	62,3	115,1	225,6	56,8	63,6
15-35	503,0	628,7	448,2	303,1	50,5	69,9	130,0
36-60	3,4	217,1	205,0	0,0	12,1	3,4	0,0
61-90	54,3	271,4	216,0	0,0	5,4	4,3	50,0
91-180	562,7	230,6	140,0	307,7	10,6	175,0	80,0
>180	233,1	47,0	37,2	232,4	9,8	0,7	0,0
<b>Total</b>	<b>1591,9</b>	<b>1746,3</b>	<b>1108,7</b>	<b>958,3</b>	<b>314,0</b>	<b>310,0</b>	<b>323,6</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		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.59%	4.11%	5.70%	4.91%
15-35	6.62%	6.71%	6.56%	6.64%
36-60	—	6.71%	5.72%	6.49%
61-90	6.81%	6.82%	6.62%	6.81%
91-180	6.84%	6.62%	6.55%	6.62%
>180	—	7.34%	7.47%	7.36%
<b>Total</b>	<b>6.70%</b>	<b>5.89%</b>	<b>6.38%</b>	<b>6.22%</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	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>	12	57	960	1004	45	271	8262	8875	47	136	6539	6757
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	248	295	0	0	4748	3880	0	0	4423	3413
Otros <sup>c</sup>	57	12	429	335	271	45	1853	2042	136	47	310	1047
<b>Total</b>	<b>69</b>	<b>69</b>	<b>1637</b>	<b>1634</b>	<b>316</b>	<b>316</b>	<b>14863</b>	<b>14797</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>11272</b>	<b>11217</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.