

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 28 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 26 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\$2262 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.03%<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	360,6	633,7	157,7	175,8	380,0	88,8	96,0
15-35	502,8	597,7	366,4	276,2	42,5	37,7	188,9
36-60	138,0	10,3	0,0	30,0	10,3	108,0	0,0
61-90	25,1	46,4	15,0	4,8	11,4	0,3	20,0
91-180	163,2	105,4	30,7	0,0	14,7	103,2	60,0
>180	20,2	33,2	20,0	9,5	3,2	0,8	10,0
<b>Total</b>	<b>1210,0</b>	<b>1426,8</b>	<b>589,8</b>	<b>496,3</b>	<b>462,1</b>	<b>338,7</b>	<b>374,9</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	6.67%	5.08%	6.05%	5.55%
15-35	6.62%	6.08%	5.87%	6.17%
36-60	—	7.20%	6.63%	6.68%
61-90	6.82%	7.18%	6.75%	6.92%
91-180	6.81%	6.99%	6.52%	6.69%
>180	7.45%	7.44%	7.43%	7.44%
<b>Total</b>	<b>6.70%</b>	<b>5.62%</b>	<b>6.17%</b>	<b>6.03%</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	25 – 29 jul.				01 - 05 ago.				08 - 12 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	46	218	7482	7944	49	137	6809	7711	16	256	6308	5686
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4331	3720	0	0	4513	3487	0	0	3437	2767
Otros <sup>c</sup>	218	46	1639	1711	137	49	1004	1074	256	16	606	1795
<b>Total</b>	<b>264</b>	<b>264</b>	<b>13452</b>	<b>13375</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>12326</b>	<b>12272</b>	<b>272</b>	<b>272</b>	<b>10351</b>	<b>10248</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.