

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 29 de julio de 2022**  
**Fecha de Información: 27 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\$2769 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.43%<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	412,5	536,8	198,8	77,5	127,1	124,0	211,0
15-35	477,9	933,3	578,7	246,9	163,8	40,2	190,8
36-60	64,9	32,5	6,0	0,0	16,5	54,9	10,0
61-90	80,2	47,4	0,0	25,0	17,4	25,2	30,0
91-180	453,1	100,4	45,0	367,8	25,4	55,3	30,0
>180	70,0	88,2	13,5	11,2	18,7	2,8	56,0
<b>Total</b>	<b>1558,6</b>	<b>1738,5</b>	<b>842,0</b>	<b>728,4</b>	<b>368,8</b>	<b>302,5</b>	<b>527,8</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	6.39%	6.48%	5.32%	6.13%
15-35	6.39%	6.26%	6.32%	6.30%
36-60	6.42%	6.79%	6.51%	6.57%
61-90	6.62%	6.78%	6.53%	6.62%
91-180	6.80%	7.01%	6.76%	6.78%
>180	7.58%	7.50%	7.40%	7.54%
<b>Total</b>	<b>6.55%</b>	<b>6.39%</b>	<b>6.38%</b>	<b>6.43%</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>	43	189	6109	6481	54	137	6916	7897	24	258	6358	5732
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3436	2763	0	0	4539	3527	0	0	3438	2767
Otros <sup>c</sup>	189	43	1467	1694	137	54	1109	1086	258	24	614	1809
<b>Total</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>11012</b>	<b>10938</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>12564</b>	<b>12510</b>	<b>282</b>	<b>282</b>	<b>10410</b>	<b>10308</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.