

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 01 de agosto de 2022**  
**Fecha de Información: 28 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\$1750 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.02%<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	307,2	299,0	185,2	152,7	17,5	58,2	96,2
15-35	468,1	505,8	272,5	315,7	143,1	62,2	90,2
36-60	57,1	23,8	0,0	39,8	23,8	17,3	0,0
61-90	28,9	60,8	8,2	7,2	32,7	1,7	20,0
91-180	65,7	55,7	20,0	55,0	25,7	0,7	10,0
>180	69,1	77,6	18,0	16,4	7,6	0,7	52,0
<b>Total</b>	<b>996,1</b>	<b>1022,8</b>	<b>503,9</b>	<b>586,7</b>	<b>250,5</b>	<b>140,9</b>	<b>268,4</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	6.49%		5.45%	3.30%	4.60%
15-35	6.45%		6.45%	6.29%	6.40%
36-60	—		6.83%	6.30%	6.56%
61-90	6.66%		6.90%	5.38%	6.76%
91-180	6.81%		7.07%	6.84%	6.93%
>180	7.55%		7.49%	7.54%	7.53%
<b>Total</b>	<b>6.71%</b>		<b>6.45%</b>	<b>5.14%</b>	<b>6.02%</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>	35	107	3434	3493	55	140	6995	8040	29	261	6390	5775
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	1709	1498	0	0	4671	3586	0	0	3469	2783
Otros <sup>c</sup>	107	35	855	940	140	55	1112	1095	261	29	616	1815
<b>Total</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>5998</b>	<b>5931</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>12778</b>	<b>12721</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>10475</b>	<b>10373</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.