

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 04 de agosto de 2022**  
**Fecha de Información: 02 de agosto 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\$2824 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.67%<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	705,6	864,7	360,6	335,1	142,1	8,5	362,0
15-35	630,2	818,0	391,3	218,6	31,9	16,9	394,7
36-60	306,3	49,1	0,0	0,0	39,1	296,3	10,0
61-90	0,1	13,4	0,0	0,0	13,4	0,1	0,0
91-180	9,9	62,8	40,0	0,0	20,4	7,5	2,4
>180	100,3	122,5	30,0	10,0	2,5	0,3	90,0
<b>Total</b>	<b>1752,5</b>	<b>1930,5</b>	<b>822,0</b>	<b>563,7</b>	<b>249,4</b>	<b>329,7</b>	<b>859,1</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	6.93%		6.18%	6.72%	6.61%
15-35	6.47%		6.44%	6.71%	6.51%
36-60	6.70%		6.87%	6.66%	6.68%
61-90	—		6.91%	6.70%	6.91%
91-180	6.83%		6.83%	6.25%	6.77%
>180	8.59%		7.05%	6.86%	8.26%
<b>Total</b>	<b>6.89%</b>		<b>6.39%</b>	<b>6.69%</b>	<b>6.67%</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	01 - 05 ago.				08 - 12 ago.				15 - 19 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	47	107	6507	7027	31	269	6826	6753	10	155	2914	4896
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4325	3759	0	0	3764	2848	0	0	3185	1299
Otros <sup>c</sup>	107	47	559	549	269	31	949	1835	155	10	701	553
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>11391</b>	<b>11335</b>	<b>300</b>	<b>300</b>	<b>11539</b>	<b>11436</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>6800</b>	<b>6748</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.