

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 08 de agosto de 2022**  
**Fecha de Información: 04 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\$1941 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.14%<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	506,8	409,8	367,8	479,5	41,9	27,2	0,1
15-35	310,4	564,6	395,7	163,0	39,3	17,7	129,6
36-60	29,7	92,5	40,8	8,0	51,7	21,7	0,0
61-90	30,9	76,0	31,7	0,0	14,1	0,7	30,2
91-180	30,3	57,4	0,0	0,0	27,4	0,3	30,0
>180	11,7	16,1	0,0	4,3	11,1	2,4	5,0
<b>Total</b>	<b>919,9</b>	<b>1216,4</b>	<b>836,0</b>	<b>654,8</b>	<b>185,5</b>	<b>70,0</b>	<b>195,0</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	7.00%		4.75%	6.22%	5.53%
15-35	6.90%		6.60%	6.02%	6.51%
36-60	—		7.08%	6.76%	6.96%
61-90	6.85%		7.07%	6.56%	6.91%
91-180	6.85%		7.08%	6.76%	6.96%
>180	7.01%		7.28%	7.06%	7.16%
<b>Total</b>	<b>6.89%</b>		<b>5.92%</b>	<b>6.20%</b>	<b>6.14%</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	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>	24	67	4671	4762	39	270	7098	7334	11	157	3296	4989
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3119	2681	0	0	4247	3067	0	0	3206	1601
Otros <sup>c</sup>	67	24	106	410	270	39	1027	1868	157	11	752	606
<b>Total</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>7896</b>	<b>7853</b>	<b>309</b>	<b>309</b>	<b>12372</b>	<b>12269</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>7254</b>	<b>7196</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.