

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 16 de agosto de 2022**  
**Fecha de Información: 11 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\$2256 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.15%<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	431,4	489,0	234,3	259,5	110,0	27,2	144,7
15-35	602,0	681,8	342,7	322,0	0,0	6,9	273,1
36-60	55,2	154,6	106,5	0,0	48,1	55,2	0,0
61-90	2,8	20,4	0,0	0,0	20,4	2,8	0,0
91-180	84,5	93,4	0,0	30,0	43,3	4,3	50,1
>180	52,0	57,0	50,0	50,0	7,0	2,0	0,0
<b>Total</b>	<b>1227,7</b>	<b>1496,1</b>	<b>733,5</b>	<b>661,4</b>	<b>228,8</b>	<b>98,4</b>	<b>467,9</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		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.26%		6.43%	5.02%	5.80%
15-35	6.02%		6.15%	6.24%	6.14%
36-60	—		6.63%	6.30%	6.45%
61-90	—		6.71%	4.05%	6.39%
91-180	6.82%		6.89%	6.76%	6.83%
>180	—		7.02%	6.99%	7.00%
<b>Total</b>	<b>6.18%</b>		<b>6.39%</b>	<b>5.87%</b>	<b>6.15%</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)  $^{\wedge}$  (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

"Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	08 – 12 ago.				15 - 19 ago.				22 - 26 ago.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	39	94	4632	5217	17	171	4393	5383	26	226	3759	4243
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	3013	2055	0	0	3271	2463	0	0	2181	1304
Otros <sup>c</sup>	94	39	956	1274	170	17	940	701	226	26	782	1147
<b>Total</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>8601</b>	<b>8546</b>	<b>187</b>	<b>188</b>	<b>8604</b>	<b>8547</b>	<b>252</b>	<b>252</b>	<b>6722</b>	<b>6694</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.