

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2022**  
**Fecha de Información: 22 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\$2148 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.47%<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	388,9	372,9	289,0	231,5	14,0	87,3	70
15-35	499,8	556,1	347,8	338,7	97,3	50,1	111
36-60	47,3	18,3	11,7	30,5	6,5	16,8	0
61-90	79,5	4,8	2,4	73,8	2,4	5,7	0
91-180	58,7	152,1	93,0	0,0	19,1	18,7	40
>180	29,3	171,6	160,0	10,0	1,6	9,3	10
<b>Total</b>	<b>1103,5</b>	<b>1275,8</b>	<b>903,9</b>	<b>684,6</b>	<b>140,9</b>	<b>188,0</b>	<b>231</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	6.60%		6.15%	5.80%	6.01%
15-35	6.48%		6.53%	6.43%	6.49%
36-60	—		6.75%	6.64%	6.65%
61-90	—		6.87%	6.62%	6.73%
91-180	6.96%		6.96%	6.75%	6.93%
>180	7.17%		7.23%	6.81%	7.20%
<b>Total</b>	<b>6.63%</b>		<b>6.68%</b>	<b>6.16%</b>	<b>6.47%</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	22 – 26 ago.				29 ago. - 02 sep.				05 - 09 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero <sup>a</sup>	41	239	5383	6192	36	181	6653	6643	17	146	3304	3458
Intragrupo y off-shore <sup>b</sup>	1	0	2613	2051	0	0	4150	3372	0	0	2238	1650
Otros <sup>c</sup>	238	41	1619	1332	181	36	730	1474	146	17	383	762
<b>Total</b>	<b>280</b>	<b>280</b>	<b>9615</b>	<b>9575</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>11533</b>	<b>11489</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>5925</b>	<b>5870</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.