

# INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

**Fecha de Publicación: 11 de agosto de 2022**  
**Fecha de Información: 09 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\$1851 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.56%<sup>2</sup>.

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados<sup>a</sup>

Rango	Sector Financiero <sup>b</sup>		Intragruppo y Off-shore <sup>c</sup>		Otros Agentes		Intermediarios del Mercado Cambiario
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	582,8	300,0	144,0	427,0	60,6	60,4	95,4
15-35	200,5	293,5	139,0	87,3	90,5	49,2	64,0
36-60	104,1	313,0	275,9	32,0	27,1	62,1	10,0
61-90	20,8	28,7	0,0	0,0	28,7	20,8	0,0
91-180	52,1	81,0	50,0	0,0	11,0	32,1	20,0
>180	55,2	18,4	0,0	40,0	8,4	5,2	10,0
<b>Total</b>	<b>1015,5</b>	<b>1034,7</b>	<b>608,9</b>	<b>586,3</b>	<b>226,5</b>	<b>229,8</b>	<b>199,4</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		Total
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	
3-14	6.56%		6.56%	6.35%	6.47%
15-35	6.53%		6.66%	6.39%	6.55%
36-60	6.53%		6.71%	6.54%	6.57%
61-90	-		6.69%	6.52%	6.62%
91-180	6.68%		6.76%	6.66%	6.72%
>180	6.93%		7.25%	6.90%	6.95%
<b>Total</b>	<b>6.58%</b>		<b>6.65%</b>	<b>6.46%</b>	<b>6.56%</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . 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>	41	233	6433	7343	15	160	3933	5137	24	204	3522	3967
Intragruppo y off-shore <sup>b</sup>	0	0	4149	3015	0	0	3226	2109	0	0	2052	1254
Otros <sup>c</sup>	233	41	1395	1518	159	15	820	675	204	24	748	1072
<b>Total</b>	<b>274</b>	<b>274</b>	<b>11977</b>	<b>11876</b>	<b>174</b>	<b>175</b>	<b>7979</b>	<b>7921</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>6322</b>	<b>6293</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.