

**Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2018**

**Fecha de Información: 16 de mayo de 2018 <sup>1</sup>**

## **INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2224.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	386.6	267.4	101.5	202.0	21.9	40.6	144.0
15-35	724.0	862.6	280.1	105.3	185.1	221.2	397.5
36-60	155.9	174.5	0.0	0.0	174.5	155.9	0.0
61-90	84.7	98.0	0.0	0.0	18.0	4.7	80.0
91-180	27.5	51.3	0.0	0.0	26.3	2.5	25.0
>180	25.1	33.8	5.0	0.0	8.8	5.1	20.0
<b>Total</b>	<b>1403.7</b>	<b>1487.7</b>	<b>386.6</b>	<b>307.3</b>	<b>434.6</b>	<b>429.9</b>	<b>666.5</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

**Cuadro No. 2**

### **Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada**

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.9 %	2.2 %	1.1 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.5 %	2.0 %	1.3 %	1.6 %
91-180	1.4 %	1.8 %	1.2 %	1.6 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.5 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.7 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	14 al 18 de mayo				21 al 25 de mayo				28 de may. al 1 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	27	140	4816	4687	44	139	4100	4477	8	160	3946	3883
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1863	1299	0	0	1808	1054	0	0	1465	1363
<b>Otros</b>	140	27	1166	1858	139	44	1559	1937	160	8	1302	1468
<b>Total</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>7844</b>	<b>7844</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>7468</b>	<b>7468</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6714</b>	<b>6714</b>

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.