

**Fecha de Publicación: 21 de mayo de 2018**

**Fecha de Información: 17 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\$2303.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<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	345.0	309.5	211.5	172.0	9.0	84.0	89.0
15-35	565.8	845.7	551.4	87.5	92.3	276.3	202.0
36-60	189.8	34.3	0.0	0.0	34.3	189.8	0.0
61-90	35.9	13.2	0.0	0.0	3.2	25.9	10.0
91-180	31.5	13.9	0.0	20.0	12.9	10.5	1.0
>180	193.1	52.7	14.0	148.5	13.7	19.6	25.0
<b>Total</b>	<b>1361.1</b>	<b>1269.2</b>	<b>776.9</b>	<b>428.0</b>	<b>165.3</b>	<b>606.1</b>	<b>327.0</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	1.7 %		1.1 %	0.6 %	1.0 %
15-35	1.8 %		1.9 %	1.8 %	1.8 %
36-60	-		2.9 %	1.5 %	1.7 %
61-90	1.6 %		2.0 %	1.3 %	1.5 %
91-180	1.3 %		1.9 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.8 %		1.9 %	1.6 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>		<b>1.7 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.6 %</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
Sector Financiero**	27	146	4891	4763	47	139	4281	4670	8	160	4036	3939
Intragrupo y off-shore***	0	0	1903	1363	0	0	1945	1162	0	0	1499	1366
Otros	146	27	1182	1851	139	47	1561	1955	160	8	1309	1539
<b>Total</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>7976</b>	<b>7976</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>7787</b>	<b>7787</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6844</b>	<b>6844</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:  $((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.