

**Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2018**

**Fecha de Información: 24 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\$1901.2 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	223.1	232.2	83.0	70.0	36.2	40.1	113.0
15-35	805.8	648.4	297.8	174.2	118.6	399.6	232.0
36-60	54.0	52.2	0.0	0.0	52.2	54.0	0.0
61-90	75.4	93.2	0.0	0.3	73.2	55.1	20.0
91-180	0.3	30.4	0.0	0.0	30.4	0.3	0.0
>180	35.1	51.1	15.0	0.0	1.1	0.1	35.0
<b>Total</b>	<b>1193.7</b>	<b>1107.4</b>	<b>395.8</b>	<b>244.6</b>	<b>311.6</b>	<b>549.1</b>	<b>400.0</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 %	1.2 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
61-90	1.4 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	2.0 %	1.4 %	2.0 %
>180	1.6 %	2.5 %	1.6 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.6 %</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	21 al 25 de mayo				28 de may. al 1 de junio				4 al 8 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	49	146	5197	5250	15	173	4627	4665	30	124	2987	3560
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2292	1749	0	0	1772	1536	0	0	1667	1041
<b>Otros</b>	146	49	1582	2072	173	15	1404	1602	124	30	865	918
<b>Total</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>9071</b>	<b>9071</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>7803</b>	<b>7803</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>5519</b>	<b>5519</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.