

**Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2018**

**Fecha de Información: 29 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\$2544.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	419.4	356.8	101.0	114.0	65.1	114.7	190.8
15-35	798.7	747.6	281.6	186.0	168.8	315.5	297.2
36-60	281.5	274.4	5.0	0.0	219.4	231.5	50.0
61-90	15.9	30.9	0.0	0.0	30.9	15.9	0.0
91-180	72.5	34.6	0.0	45.0	29.6	22.5	5.0
>180	30.6	39.4	22.0	10.0	2.4	5.6	15.0
<b>Total</b>	<b>1618.6</b>	<b>1483.7</b>	<b>409.6</b>	<b>355.0</b>	<b>516.1</b>	<b>705.6</b>	<b>558.0</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	1.9 %		1.9 %	1.6 %	1.8 %
15-35	1.9 %		1.8 %	1.6 %	1.8 %
36-60	1.9 %		1.7 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-		2.0 %	1.3 %	1.7 %
91-180	1.0 %		1.8 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.8 %		1.7 %	1.9 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>		<b>1.8 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.8 %</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	28 de may. al 1 de junio				4 al 8 de junio				11 al 15 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	177	5306	5428	39	125	3326	3729	34	123	3840	3843
Intragrupo y off-shore***	0	0	2401	2056	0	0	1683	1165	0	0	1281	825
Otros	177	31	1418	1641	125	39	932	1047	123	34	1302	1755
<b>Total</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>9125</b>	<b>9125</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>5942</b>	<b>5942</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>6423</b>	<b>6423</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.