

**Fecha de Publicación: 1 de junio de 2018**

**Fecha de Información: 30 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\$2933.1 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	808.0	669.3	415.0	565.8	48.0	36.0	206.3
15-35	650.2	746.1	252.8	201.5	130.1	85.5	363.3
36-60	249.1	102.3	0.0	0.0	102.3	249.1	0.0
61-90	31.5	52.4	0.0	0.0	22.4	1.5	30.0
91-180	33.3	80.5	50.0	30.0	30.5	3.3	0.0
>180	72.3	52.6	25.0	55.0	12.6	2.3	15.0
<b>Total</b>	<b>1844.4</b>	<b>1703.2</b>	<b>742.8</b>	<b>852.2</b>	<b>345.9</b>	<b>377.7</b>	<b>614.5</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	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	2.1 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	1.6 %	1.8 %	1.3 %	1.7 %
91-180	-	2.1 %	1.6 %	1.8 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.9 %</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
<b>Sector Financiero**</b>	31	179	5957	5940	41	128	3440	3812	38	123	3935	3954
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2801	2584	0	0	1698	1203	0	0	1295	825
<b>Otros</b>	179	31	1405	1639	128	41	934	1057	123	38	1353	1804
<b>Total</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>10163</b>	<b>10163</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>6072</b>	<b>6072</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>6583</b>	<b>6583</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.