

**Fecha de Publicación: 5 de junio de 2018**

**Fecha de Información: 31 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\$1852.7 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	128.7	151.7	41.8	40.0	64.9	43.7	45.0
15-35	404.9	692.4	426.2	85.7	160.2	213.1	106.0
36-60	279.6	117.8	0.0	0.0	117.8	279.6	0.0
61-90	41.5	16.3	0.0	20.0	6.3	11.5	10.0
91-180	62.9	30.8	0.0	40.0	20.8	12.9	10.0
>180	71.6	60.6	20.0	35.0	5.6	1.6	35.0
<b>Total</b>	<b>989.2</b>	<b>1069.6</b>	<b>487.9</b>	<b>220.7</b>	<b>375.7</b>	<b>562.4</b>	<b>206.0</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	1.5 %		1.6 %	1.3 %	1.5 %
15-35	1.5 %		1.5 %	1.5 %	1.5 %
36-60	-		1.7 %	1.6 %	1.6 %
61-90	1.5 %		1.7 %	1.4 %	1.5 %
91-180	1.5 %		2.0 %	1.4 %	1.6 %
>180	1.7 %		2.0 %	1.7 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>		<b>1.6 %</b>	<b>1.5 %</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	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**	29	184	5991	5970	44	131	3504	3859	39	123	3964	4019
Intragrupo y off-shore***	0	0	2815	2601	0	0	1716	1226	0	0	1305	825
Otros	184	29	1411	1647	131	44	948	1082	123	39	1388	1814
<b>Total</b>	<b>213</b>	<b>213</b>	<b>10218</b>	<b>10218</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>6168</b>	<b>6168</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>6658</b>	<b>6658</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.