

Fecha de Publicación: 6 de junio de 2018

Fecha de Información: 01 de junio 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\$1699.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<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	245.7	188.4	103.5	122.0	21.9	60.7	63.0
15-35	609.8	609.4	212.5	204.5	23.9	32.3	373.0
36-60	120.1	62.4	0.0	0.0	62.4	120.1	0.0
61-90	11.1	4.5	0.0	10.0	4.5	1.1	0.0
91-180	65.3	133.7	50.0	0.0	33.7	15.3	50.0
>180	95.0	70.3	20.0	60.0	20.3	5.0	30.0
<b>Total</b>	<b>1147.1</b>	<b>1068.8</b>	<b>386.0</b>	<b>396.5</b>	<b>166.8</b>	<b>234.6</b>	<b>516.0</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 %	1.2 %	1.4 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	1.5 %	1.4 %	1.4 %
61-90	-	2.2 %	1.5 %	1.7 %
91-180	1.5 %	1.9 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.7 %	2.4 %	1.8 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.5 %</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	181	5990	5971	41	136	3692	4031	40	125	4021	4029
Intragrupo y off-shore***	0	0	2815	2601	0	0	1818	1348	0	0	1306	825
Otros	181	29	1413	1647	136	41	953	1085	125	40	1397	1870
<b>Total</b>	<b>210</b>	<b>210</b>	<b>10218</b>	<b>10218</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>6464</b>	<b>6464</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>6724</b>	<b>6724</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.