

**Fecha de Publicación: 21 de junio de 2018**

**Fecha de Información: 19 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\$2049.0 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	158.6	248.5	163.0	112.5	65.5	26.1	20.0
15-35	423.5	615.4	444.0	133.3	32.4	151.3	139.0
36-60	262.0	337.2	10.0	20.2	307.2	221.7	20.0
61-90	4.4	2.0	0.0	0.0	2.0	4.4	0.0
91-180	53.8	43.6	10.0	10.0	23.6	33.8	10.0
>180	83.1	30.9	0.0	45.0	5.9	13.1	25.0
<b>Total</b>	<b>985.5</b>	<b>1277.6</b>	<b>627.0</b>	<b>321.0</b>	<b>436.6</b>	<b>450.5</b>	<b>214.0</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 %		1.7 %	1.2 %	1.5 %
15-35	1.8 %		1.7 %	1.5 %	1.7 %
36-60	1.6 %		1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-		2.4 %	1.2 %	1.6 %
91-180	1.6 %		1.7 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.8 %		3.2 %	1.7 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>		<b>1.7 %</b>	<b>1.4 %</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	18 al 22 de junio				25 al 29 de junio				2 al 6 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	123	6183	5979	12	176	3092	3862	20	72	1636	1499
Intragrupo y off-shore***	0	0	2512	2254	0	0	1788	988	0	0	673	477
Otros	123	36	1713	2174	175	12	1119	1150	72	20	331	663
<b>Total</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>10407</b>	<b>10407</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>6000</b>	<b>6000</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>2639</b>	<b>2639</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.