

**Fecha de Publicación: 29 de junio de 2018**

**Fecha de Información: 27 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\$1725.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	135.6	198.6	162.0	86.5	4.2	16.6	32.5
15-35	444.8	507.3	298.0	76.3	28.8	187.9	180.5
36-60	207.1	272.5	0.0	0.0	272.5	207.1	0.0
61-90	15.4	6.4	0.0	0.0	6.4	15.4	0.0
91-180	81.0	32.9	0.0	11.2	15.9	52.7	17.0
>180	35.8	38.4	10.0	3.6	8.4	12.2	20.0
<b>Total</b>	<b>919.6</b>	<b>1056.2</b>	<b>470.0</b>	<b>177.7</b>	<b>336.3</b>	<b>492.0</b>	<b>250.0</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	1.8 %	1.8 %	1.5 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.5 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
61-90	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.7 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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:  $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	25 al 29 de junio				2 al 6 de julio				9 al 13 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	17	178	4307	4713	35	71	1908	1971	17	119	3523	3599
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2292	1780	0	0	886	493	0	0	1387	915
<b>Otros</b>	178	17	1155	1261	71	35	362	692	119	17	1049	1444
<b>Total</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>7754</b>	<b>7754</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>3155</b>	<b>3155</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>5959</b>	<b>5959</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.