

Fecha de Publicación: 5 de julio de 2018

Fecha de Información: 03 de julio 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\$1394.9 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	294.9	111.8	16.0	202.3	13.3	10.1	82.5
15-35	445.6	433.4	265.3	160.3	36.7	153.9	131.5
36-60	144.9	71.9	0.0	0.1	71.9	144.7	0.0
61-90	16.5	45.5	35.1	0.0	10.5	16.5	0.0
91-180	1.6	31.1	0.2	0.0	30.9	1.6	0.0
>180	2.2	9.4	0.0	0.0	9.4	2.2	0.0
<b>Total</b>	<b>905.7</b>	<b>703.2</b>	<b>316.5</b>	<b>362.7</b>	<b>172.6</b>	<b>329.0</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	1.9 %	1.0 %	1.6 %	1.6 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
61-90	-	2.3 %	1.5 %	1.8 %
91-180	-	2.1 %	1.7 %	2.1 %
>180	-	2.1 %	1.8 %	2.0 %
<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.

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

Sectores	2 al 6 de julio				9 al 13 de julio				16 al 20 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	36	82	2366	2248	18	118	3711	3717	22	119	4483	5278
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1024	791	0	0	1387	976	0	0	2709	1116
<b>Otros</b>	82	36	374	726	118	18	1073	1479	119	22	1015	1813
<b>Total</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>3764</b>	<b>3764</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>6172</b>	<b>6172</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>8207</b>	<b>8207</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.