

Fecha de Publicación: 6 de julio de 2018

Fecha de Información: 04 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\$120.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.1%.<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	81.2	81.4	0.0	0.0	1.4	1.2	80.0
15-35	5.3	23.0	5.0	5.0	18.0	0.3	0.0
36-60	0.2	1.8	0.0	0.0	1.8	0.2	0.0
61-90	0.0	2.0	0.0	0.0	2.0	0.0	0.0
91-180	0.0	2.9	0.0	0.0	2.9	0.0	0.0
>180	0.3	2.0	0.0	0.0	2.0	0.3	0.0
<b>Total</b>	<b>87.1</b>	<b>113.0</b>	<b>5.0</b>	<b>5.0</b>	<b>28.0</b>	<b>2.1</b>	<b>80.0</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	2.1 %	4.5 %	0.8 %	2.2 %
15-35	-	2.1 %	1.6 %	2.0 %
36-60	-	2.4 %	1.5 %	2.3 %
61-90	-	2.2 %	1.0 %	2.2 %
91-180	-	2.2 %	-	2.2 %
>180	-	2.5 %	1.8 %	2.4 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>2.1 %</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	2385	2285	19	119	3770	3777	22	119	4484	5278
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1024	791	0	0	1387	976	0	0	2709	1116
<b>Otros</b>	82	36	392	725	119	19	1074	1478	119	22	1015	1814
<b>Total</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>3801</b>	<b>3801</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>6231</b>	<b>6231</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>8208</b>	<b>8208</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.