

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2018

Fecha de Información: 18 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\$2646.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	262.8	297.7	109.7	135.1	79.0	18.7	109.0
15-35	829.9	1105.7	407.6	122.9	507.6	516.5	190.5
36-60	169.4	154.6	0.0	0.0	154.6	169.4	0.0
61-90	55.9	8.2	0.0	10.0	8.2	45.9	0.0
91-180	16.4	35.0	0.0	0.0	19.0	0.4	16.0
>180	15.4	16.4	0.0	10.0	11.4	0.4	5.0
<b>Total</b>	<b>1349.7</b>	<b>1617.5</b>	<b>517.3</b>	<b>278.0</b>	<b>779.7</b>	<b>751.3</b>	<b>320.5</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	2.4 %	2.1 %	1.6 %	2.0 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.0 %
36-60	-	2.1 %	2.0 %	2.0 %
61-90	-	2.7 %	1.8 %	2.0 %
91-180	2.0 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.0 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.0 %</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**

Sector	16 al 20 de julio				23 al 27 de julio				30 de jul. al 3 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	24	143	6364	6343	26	122	4142	4757	12	143	3253	3511
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2929	2259	0	0	2118	1257	0	0	1255	876
<b>Otros</b>	143	24	1222	1914	122	26	1153	1399	143	12	1406	1527
<b>Total</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>10516</b>	<b>10516</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>7413</b>	<b>7413</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>5914</b>	<b>5914</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.