

Fecha de Publicación: 26 de julio de 2018

Fecha de Información: 24 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\$2044.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	361.4	140.0	70.0	305.0	19.5	5.9	50.5
15-35	656.3	767.6	436.0	161.5	44.1	207.3	287.5
36-60	175.5	74.0	2.5	0.0	71.5	175.5	0.0
61-90	52.1	46.0	0.0	5.0	6.0	7.1	40.0
91-180	59.7	69.8	0.0	30.0	48.7	8.6	21.1
>180	32.7	8.5	5.0	30.0	3.5	2.7	0.0
<b>Total</b>	<b>1337.7</b>	<b>1105.9</b>	<b>513.5</b>	<b>531.5</b>	<b>193.3</b>	<b>407.1</b>	<b>399.1</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.4 %	1.3 %	2.1 %	1.9 %
15-35	2.3 %	2.4 %	2.2 %	2.3 %
36-60	-	2.2 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.1 %	2.3 %	1.9 %	2.1 %
91-180	2.0 %	2.2 %	2.0 %	2.1 %
>180	-	2.2 %	1.6 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.2 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.2 %</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	23 al 27 de julio				30 de jul. al 3 de agosto				6 al 10 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	37	132	4758	5150	17	143	3523	3802	10	95	5080	5519
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2362	1705	0	0	1448	1036	0	0	1693	879
<b>Otros</b>	132	37	1157	1423	143	17	1424	1557	95	10	2459	2834
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>8277</b>	<b>8277</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>6395</b>	<b>6395</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>9232</b>	<b>9232</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.