

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2018

Fecha de Información: 27 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\$1514.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	274.2	184.3	69.0	137.5	50.3	71.7	65.0
15-35	384.2	531.0	241.0	89.5	50.0	54.7	240.0
36-60	185.5	166.3	17.0	0.0	72.3	108.5	77.0
61-90	10.5	32.2	10.0	0.0	12.2	0.5	10.0
91-180	42.1	58.5	0.0	0.0	18.5	2.1	40.0
>180	50.6	31.9	20.0	33.0	6.9	12.6	5.0
<b>Total</b>	<b>947.1</b>	<b>1004.3</b>	<b>357.0</b>	<b>260.0</b>	<b>210.3</b>	<b>250.1</b>	<b>437.0</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 %	1.3 %	0.9 %	1.2 %
15-35	2.1 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
36-60	2.0 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
61-90	2.0 %	2.1 %	1.7 %	2.0 %
91-180	1.9 %	2.3 %	1.6 %	2.0 %
>180	2.0 %	2.0 %	2.0 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.9 %</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>	38	134	5046	5270	22	148	4017	4113	10	101	5222	5800
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2428	1941	0	0	1514	1262	0	0	1860	896
<b>Otros</b>	134	38	1160	1424	148	22	1495	1650	101	10	2478	2864
<b>Total</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>8635</b>	<b>8635</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>7025</b>	<b>7025</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>9560</b>	<b>9560</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.