

Fecha de Publicación: 2 de agosto de 2018

Fecha de Información: 31 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\$2385.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	474.6	345.5	178.0	280.8	58.5	84.8	109.0
15-35	412.6	735.2	407.1	137.6	204.8	151.7	123.3
36-60	149.0	165.2	0.0	0.0	158.2	142.0	7.0
61-90	8.1	17.3	0.0	0.0	17.3	8.1	0.0
91-180	23.5	39.7	0.0	10.0	29.7	3.5	10.0
>180	240.5	53.2	20.0	205.0	3.2	5.5	30.0
<b>Total</b>	<b>1308.4</b>	<b>1356.1</b>	<b>605.1</b>	<b>633.4</b>	<b>471.8</b>	<b>395.7</b>	<b>279.3</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	1.5 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
15-35	1.7 %	1.8 %	1.7 %	1.7 %
36-60	1.7 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.4 %	1.7 %	2.1 %
91-180	1.8 %	2.4 %	1.6 %	2.1 %
>180	1.9 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.7 %</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	30 de jul. al 3 de agosto				6 al 10 de agosto				13 al 17 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	150	4329	4299	11	102	5622	6091	17	136	3835	4145
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1579	1448	0	0	1981	1100	0	0	1645	864
<b>Otros</b>	150	24	1499	1660	102	11	2540	2953	136	17	1321	1792
<b>Total</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>7407</b>	<b>7407</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>10143</b>	<b>10143</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>6801</b>	<b>6801</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 intragrupo.