

Fecha de Publicación: 6 de agosto de 2018

Fecha de Información: 02 de agosto 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\$1996.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	380.6	400.3	143.0	130.0	49.3	42.6	208.0
15-35	492.6	665.9	354.0	153.0	69.9	97.6	242.0
36-60	218.3	198.6	0.0	3.2	178.6	195.1	20.0
61-90	13.3	13.1	0.0	0.2	3.1	3.1	10.0
91-180	3.6	34.7	15.0	0.0	19.7	3.6	0.0
>180	49.6	40.4	0.0	0.0	5.4	14.6	35.0
<b>Total</b>	<b>1158.0</b>	<b>1353.0</b>	<b>512.0</b>	<b>286.4</b>	<b>326.0</b>	<b>356.6</b>	<b>515.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	1.9 %	1.2 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
61-90	1.9 %	1.9 %	1.5 %	1.8 %
91-180	-	1.8 %	1.4 %	1.8 %
>180	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.6 %</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**

Sector	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>	23	149	4628	4545	15	104	6045	6488	17	133	3982	4284
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1695	1611	0	0	2040	1263	0	0	1702	904
<b>Otros</b>	149	23	1496	1664	104	15	2631	2965	133	17	1343	1839
<b>Total</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>7819</b>	<b>7819</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>10716</b>	<b>10716</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>7027</b>	<b>7027</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 intragruppo.