

Fecha de Publicación: 9 de agosto de 2018

Fecha de Información: 06 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\$1134.6 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	204.7	152.8	21.5	46.0	42.3	69.7	89.0
15-35	319.3	300.7	216.3	39.0	18.4	214.3	66.0
36-60	118.8	142.7	0.0	0.0	142.7	118.8	0.0
61-90	0.4	3.7	0.0	0.0	3.7	0.4	0.0
91-180	0.7	30.5	0.0	0.0	30.5	0.7	0.0
>180	5.0	10.3	0.0	0.0	10.3	5.0	0.0
<b>Total</b>	<b>648.9</b>	<b>640.7</b>	<b>237.8</b>	<b>85.0</b>	<b>247.9</b>	<b>408.9</b>	<b>155.0</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	2.0 %	2.0 %	1.5 %	1.8 %
15-35	2.0 %	2.1 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.9 %	1.9 %
61-90	-	2.3 %	1.7 %	2.2 %
91-180	-	2.1 %	1.7 %	2.1 %
>180	-	2.2 %	1.7 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>2.0 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.7 %</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.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	6 al 10 de agosto				13 al 17 de agosto				20 al 24 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	16	107	6209	6631	19	133	4083	4359	33	105	3329	3590
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2075	1322	0	0	1729	940	0	0	1573	978
<b>Otros</b>	107	16	2673	3004	133	19	1368	1881	105	33	969	1302
<b>Total</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>10957</b>	<b>10957</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>7180</b>	<b>7180</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>5871</b>	<b>5871</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.