

Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2018

Fecha de Información: 08 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\$3790.8 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	365.4	126.0	43.6	290.0	37.4	30.4	45.0
15-35	1084.1	1675.3	544.9	72.5	859.4	740.6	271.0
36-60	352.8	367.3	12.4	0.0	354.9	352.8	0.0
61-90	33.6	0.6	0.0	0.0	0.6	33.6	0.0
91-180	51.5	39.4	0.0	20.0	18.4	10.5	21.0
>180	29.9	1.7	0.0	20.0	1.7	9.9	0.0
<b>Total</b>	<b>1917.4</b>	<b>2210.4</b>	<b>600.9</b>	<b>402.5</b>	<b>1272.5</b>	<b>1177.9</b>	<b>337.0</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 %	1.9 %	2.0 %
15-35	2.1 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	1.8 %	1.7 %	1.8 %
61-90	-	2.3 %	1.8 %	1.8 %
91-180	1.9 %	2.1 %	1.7 %	1.9 %
>180	-	2.9 %	1.7 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.8 %</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	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	109	6509	6693	23	138	4137	4412	34	105	3438	3685
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2111	1584	3	0	1734	968	0	0	1591	1006
<b>Otros</b>	109	16	2678	3021	135	23	1402	1892	105	34	969	1307
<b>Total</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>11298</b>	<b>11298</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>7273</b>	<b>7273</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>5998</b>	<b>5998</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.