

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2018

Fecha de Información: 21 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\$1917.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	343.8	220.5	132.2	293.7	45.3	7.1	43.0
15-35	460.3	368.8	231.5	254.0	54.3	123.3	83.0
36-60	241.8	290.7	35.0	0.0	255.7	241.8	0.0
61-90	11.6	14.6	0.0	0.0	14.6	11.6	0.0
91-180	21.3	49.6	0.8	0.0	34.7	7.3	14.0
>180	5.1	29.6	5.0	4.6	24.6	0.5	0.0
<b>Total</b>	<b>1083.8</b>	<b>973.7</b>	<b>404.5</b>	<b>552.3</b>	<b>429.1</b>	<b>391.5</b>	<b>140.0</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	1.9 %	2.1 %	1.0 %	1.4 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
36-60	-	2.1 %	2.0 %	2.1 %
61-90	-	3.2 %	1.8 %	2.6 %
91-180	2.0 %	2.1 %	1.8 %	2.0 %
>180	-	2.2 %	1.9 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.6 %</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	20 al 24 de agosto				27 al 31 de agosto				3 al 7 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	50	116	4484	4691	9	169	3343	4156	20	98	3066	3506
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2159	1585	0	0	2166	1057	0	0	1327	427
<b>Otros</b>	116	50	1115	1481	169	9	1088	1384	98	20	1301	1761
<b>Total</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>7758</b>	<b>7758</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>6597</b>	<b>6597</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>5694</b>	<b>5694</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.