

Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2018

Fecha de Información: 22 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\$1556.3 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	195.5	208.2	60.5	105.5	72.7	15.0	75.0
15-35	514.0	361.6	183.8	224.5	53.8	165.5	124.0
36-60	161.7	174.4	0.0	0.0	174.4	161.7	0.0
61-90	7.9	51.8	30.0	0.0	21.8	7.9	0.0
91-180	12.1	31.2	0.0	9.0	31.2	3.1	0.0
>180	0.0	36.9	25.0	0.0	11.9	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>891.2</b>	<b>864.2</b>	<b>299.3</b>	<b>339.0</b>	<b>365.9</b>	<b>353.2</b>	<b>199.0</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 %	1.6 %	1.8 %
15-35	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	2.1 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.0 %	1.4 %	1.9 %
91-180	-	2.2 %	1.4 %	2.0 %
>180	-	2.0 %	-	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.1 %</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

Sectores	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
Sector Financiero**	50	119	4590	4746	9	173	3421	4281	21	97	3127	3527
Intragruppo y off-shore***	0	0	2187	1668	0	0	2196	1080	0	0	1329	427
Otros	119	50	1116	1480	173	9	1143	1400	97	21	1310	1812
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>7894</b>	<b>7894</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>6761</b>	<b>6761</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>5766</b>	<b>5766</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.