

Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2018

Fecha de Información: 23 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\$2923.0 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	631.1	275.9	121.3	463.0	101.6	115.1	53.0
15-35	541.2	894.1	526.5	100.0	56.1	129.7	311.5
36-60	468.5	388.4	0.0	0.0	353.4	433.5	35.0
61-90	58.0	4.8	0.0	0.6	4.8	57.4	0.0
91-180	13.1	9.7	0.0	0.0	9.7	13.1	0.0
>180	15.6	32.1	20.0	0.0	2.1	5.6	10.0
<b>Total</b>	<b>1727.5</b>	<b>1605.0</b>	<b>667.8</b>	<b>563.6</b>	<b>527.7</b>	<b>754.4</b>	<b>409.5</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 %	1.7 %	1.8 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	1.8 %	2.0 %	1.9 %	2.0 %
61-90	-	2.3 %	1.8 %	1.9 %
91-180	-	2.4 %	1.7 %	2.0 %
>180	1.9 %	1.9 %	1.7 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>2.0 %</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	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**	45	116	4803	4779	14	173	3795	4489	21	98	3182	3582
Intragruppo y off-shore***	0	0	2195	1861	0	0	2291	1350	0	0	1348	427
Otros	116	45	1133	1491	173	14	1246	1494	98	21	1312	1833
<b>Total</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>8131</b>	<b>8131</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>7333</b>	<b>7333</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>5842</b>	<b>5842</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 intragruppo.