

Fecha de Publicación: 6 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 04 de septiembre 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\$2024.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	450.6	255.8	103.0	289.5	25.8	34.1	127.0
15-35	499.7	767.3	539.3	88.4	48.0	231.3	180.0
36-60	83.7	86.9	0.0	3.0	86.9	80.7	0.0
61-90	10.3	51.9	0.0	2.2	51.9	8.1	0.0
91-180	33.3	16.1	0.0	0.0	16.1	33.3	0.0
>180	54.7	36.4	17.0	0.0	4.4	39.7	15.0
<b>Total</b>	<b>1132.4</b>	<b>1214.4</b>	<b>659.3</b>	<b>383.1</b>	<b>233.1</b>	<b>427.3</b>	<b>322.0</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	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	2.0 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.0 %	1.4 %	1.9 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.8 %</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	3 al 7 de septiembre				10 al 14 de septiembre				17 al 21 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	109	4215	4501	36	107	5737	6726	71	127	4113	4112
Intragruppo y off-shore***	0	0	1788	975	0	0	3539	1193	0	0	1827	1274
Otros	109	45	1450	1977	107	36	1620	2977	127	71	1386	1939
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>7453</b>	<b>7453</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>10895</b>	<b>10895</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>7325</b>	<b>7325</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.