

Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 06 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\$1898.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<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	622.0	493.5	216.5	352.7	61.0	53.3	216.0
15-35	303.0	601.2	441.5	88.5	75.7	130.5	84.0
36-60	3.8	0.9	0.0	0.0	0.9	3.8	0.0
61-90	10.3	2.4	0.0	4.6	2.4	5.7	0.0
91-180	30.6	40.6	33.5	0.0	7.1	30.6	0.0
>180	47.2	52.4	40.0	10.0	2.4	27.2	10.0
<b>Total</b>	<b>1016.9</b>	<b>1191.1</b>	<b>731.5</b>	<b>455.8</b>	<b>149.6</b>	<b>251.1</b>	<b>310.0</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 %	1.6 %	1.1 %	1.4 %
15-35	1.9 %	1.8 %	1.8 %	1.8 %
36-60	-	2.6 %	1.3 %	1.5 %
61-90	-	2.2 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	2.2 %	1.7 %	1.8 %
>180	1.8 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.6 %</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	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	112	4344	4527	41	110	6364	6956	71	128	4392	4543
Intragruppo y off-shore***	0	0	1801	1102	0	0	3656	1718	0	0	1978	1289
Otros	112	45	1462	1978	110	41	1688	3034	128	71	1419	1956
<b>Total</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>7607</b>	<b>7607</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>11708</b>	<b>11708</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>7789</b>	<b>7789</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.