

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 10 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\$1671.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	601.7	293.1	94.8	415.4	62.3	50.3	136.0
15-35	116.1	472.0	395.0	56.0	33.0	16.1	44.0
36-60	59.7	38.7	0.0	0.0	13.7	34.7	25.0
61-90	21.1	6.9	0.0	0.0	6.9	21.1	0.0
91-180	160.8	82.9	10.0	10.8	72.9	150.0	0.0
>180	20.2	2.9	2.1	0.0	0.9	20.2	0.0
<b>Total</b>	<b>979.7</b>	<b>896.5</b>	<b>501.8</b>	<b>482.2</b>	<b>189.7</b>	<b>292.5</b>	<b>205.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.8 %	2.0 %	1.2 %	1.5 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	1.8 %	2.0 %	1.8 %	1.8 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.8 %
91-180	-	1.9 %	1.7 %	1.8 %
>180	-	2.0 %	1.9 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.7 %</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	10 al 14 de septiembre				17 al 21 de septiembre				24 al 28 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	39	122	7145	7426	72	141	4672	4777	24	116	2729	3550
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	3899	2290	0	0	2046	1352	0	0	2047	1007
<b>Otros</b>	122	39	1772	3099	141	72	1433	2021	116	24	836	1056
<b>Total</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>12815</b>	<b>12815</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>8151</b>	<b>8151</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>5612</b>	<b>5612</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 intragrupo.