

Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 18 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\$1732.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<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	314.7	395.4	296.0	196.0	29.4	48.7	70.0
15-35	442.4	406.4	224.5	231.2	41.9	71.2	140.0
36-60	109.1	129.7	0.0	0.0	129.7	109.1	0.0
61-90	13.7	16.1	0.0	0.0	16.1	13.7	0.0
91-180	91.9	13.3	0.0	86.0	13.3	5.9	0.0
>180	0.3	9.7	0.0	0.0	9.7	0.3	0.0
<b>Total</b>	<b>972.0</b>	<b>970.6</b>	<b>520.5</b>	<b>513.2</b>	<b>240.1</b>	<b>248.8</b>	<b>210.0</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	1.4 %	1.4 %	0.6 %	1.1 %
15-35	1.4 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	1.9 %	1.5 %	1.7 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	1.7 %
>180	-	2.0 %	1.5 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.3 %</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	17 al 21 de septiembre				24 al 28 de septiembre				1 al 5 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	87	148	5653	5717	36	143	3295	3982	18	103	3322	4371
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2826	2044	0	0	2137	1193	0	0	2423	727
<b>Otros</b>	148	87	1474	2192	143	36	949	1206	103	18	1053	1699
<b>Total</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>9954</b>	<b>9954</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>6381</b>	<b>6381</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>6798</b>	<b>6798</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.