

Fecha de Publicación: 24 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 20 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\$2128.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<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	429.8	294.6	32.5	160.6	29.1	36.2	233.0
15-35	492.6	563.8	188.3	204.0	140.5	53.6	235.0
36-60	329.2	271.7	0.0	35.2	271.7	294.0	0.0
61-90	38.2	123.4	45.0	15.0	78.4	23.2	0.0
91-180	6.2	20.5	0.0	0.0	20.5	6.2	0.0
>180	16.2	10.0	0.0	15.0	10.0	1.2	0.0
<b>Total</b>	<b>1312.1</b>	<b>1284.0</b>	<b>265.8</b>	<b>429.8</b>	<b>550.2</b>	<b>414.3</b>	<b>468.0</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	1.4 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
15-35	1.4 %	1.6 %	1.4 %	1.4 %
36-60	-	1.6 %	1.3 %	1.5 %
61-90	-	1.6 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-	1.9 %	1.6 %	1.8 %
>180	-	1.8 %	1.7 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.5 %</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>	88	144	5851	5902	38	152	3600	4217	24	107	3598	4538
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2941	2192	0	0	2159	1305	0	0	2446	805
<b>Otros</b>	144	88	1480	2178	152	38	1034	1270	107	24	1077	1778
<b>Total</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>10273</b>	<b>10273</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>6793</b>	<b>6793</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>7121</b>	<b>7121</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.