

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2018

Fecha de Información: 24 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\$1654.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<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	532.4	224.0	43.0	345.7	45.0	50.6	136.0
15-35	370.9	385.3	227.9	190.5	58.4	81.4	99.0
36-60	74.5	27.1	0.0	0.0	27.1	74.5	0.0
61-90	52.7	121.2	74.5	20.0	26.7	12.7	20.0
91-180	6.5	60.3	0.0	0.0	55.3	1.5	5.0
>180	2.4	57.7	49.7	0.0	7.9	2.4	0.0
<b>Total</b>	<b>1039.4</b>	<b>875.5</b>	<b>395.1</b>	<b>556.2</b>	<b>220.4</b>	<b>223.1</b>	<b>260.0</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	0.9 %	4.2 %	1.0 %	1.5 %
15-35	1.1 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
36-60	-	1.8 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
91-180	1.6 %	1.9 %	1.4 %	1.8 %
>180	-	2.3 %	1.6 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.0 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.4 %</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	24 al 28 de septiembre				1 al 5 de octubre				8 al 12 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	155	4193	4420	29	118	3816	4670	15	86	4181	4057
Intragruppo y off-shore***	0	0	2253	1742	0	0	2466	905	0	0	1643	1128
Otros	155	36	1044	1328	118	29	1099	1805	86	15	1341	1980
<b>Total</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>7490</b>	<b>7490</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>7381</b>	<b>7381</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>7165</b>	<b>7165</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.