

**Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2018**

**Fecha de Información: 25 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\$1729.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	523.1	179.7	64.5	406.5	70.2	71.6	45.0
15-35	261.0	534.2	392.3	51.2	46.9	114.9	95.0
36-60	110.7	82.1	0.0	26.0	82.1	84.7	0.0
61-90	43.2	46.4	0.0	0.0	46.4	43.2	0.0
91-180	17.6	5.0	0.0	0.0	5.0	17.6	0.0
>180	62.4	44.4	0.0	10.0	4.4	12.4	40.0
<b>Total</b>	<b>1018.2</b>	<b>891.8</b>	<b>456.8</b>	<b>493.7</b>	<b>255.0</b>	<b>344.5</b>	<b>180.0</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	0.8 %		1.2 %	0.5 %	0.7 %
15-35	0.7 %		1.5 %	0.8 %	1.2 %
36-60	-		1.3 %	1.2 %	1.3 %
61-90	-		1.7 %	1.7 %	1.7 %
91-180	-		2.2 %	1.3 %	1.5 %
>180	1.7 %		1.8 %	1.6 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.0 %</b>		<b>1.4 %</b>	<b>0.8 %</b>	<b>1.1 %</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	154	4472	4497	30	118	4060	4769	16	86	4261	4123
Intragrupo y off-shore***	0	0	2291	2005	0	0	2493	1049	0	0	1660	1128
Otros	154	36	1058	1320	118	30	1151	1885	86	16	1341	2011
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>7821</b>	<b>7821</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>7704</b>	<b>7704</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>7262</b>	<b>7262</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.