

Fecha de Publicación: 3 de octubre de 2018

Fecha de Información: 01 de octubre 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\$1679.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.5%.<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         | 198.4               | 201.6         | 172.0                      | 128.5        | 0.6           | 40.9         | 29.0           |
| 15-35        | 262.8               | 582.8         | 369.2                      | 123.3        | 104.6         | 30.5         | 109.0          |
| 36-60        | 90.6                | 91.2          | 10.0                       | 15.0         | 29.2          | 23.6         | 52.0           |
| 61-90        | 37.9                | 4.8           | 0.0                        | 8.0          | 4.8           | 29.9         | 0.0            |
| 91-180       | 105.9               | 90.0          | 40.0                       | 35.1         | 10.0          | 30.8         | 40.0           |
| >180         | 232.3               | 71.5          | 10.0                       | 50.0         | 1.5           | 122.3        | 60.0           |
| <b>Total</b> | <b>927.8</b>        | <b>1042.0</b> | <b>601.2</b>               | <b>359.8</b> | <b>150.8</b>  | <b>278.0</b> | <b>290.0</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         | 0.0 %              | 0.0 %                        | -0.1 %       | 0.0 %        |
| 15-35        | 0.3 %              | 0.3 %                        | 0.0 %        | 0.2 %        |
| 36-60        | 0.2 %              | 0.3 %                        | 0.4 %        | 0.3 %        |
| 61-90        | -                  | 1.3 %                        | 0.8 %        | 0.8 %        |
| 91-180       | 1.1 %              | 1.2 %                        | 1.0 %        | 1.1 %        |
| >180         | 1.5 %              | 1.4 %                        | 1.4 %        | 1.4 %        |
| <b>Total</b> | <b>0.6 %</b>       | <b>0.3 %</b>                 | <b>0.5 %</b> | <b>0.5 %</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

| Sectores                   | 1 al 5 de octubre |            |             |             | 8 al 12 de octubre |            |             |             | 15 al 19 de octubre |            |             |             |
|----------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
|                            | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery           |            | NDF         |             | Delivery            |            | NDF         |             |
|                            | C                 | V          | C           | V           | C                  | V          | C           | V           | C                   | V          | C           | V           |
| Sector Financiero**        | 37                | 106        | 5119        | 5286        | 24                 | 99         | 4591        | 4416        | 24                  | 121        | 2352        | 2302        |
| Intragruppo y off-shore*** | 0                 | 0          | 2800        | 1897        | 0                  | 0          | 1835        | 1298        | 0                   | 0          | 885         | 887         |
| Otros                      | 106               | 37         | 1190        | 1925        | 99                 | 24         | 1384        | 2095        | 121                 | 24         | 827         | 875         |
| <b>Total</b>               | <b>143</b>        | <b>143</b> | <b>9109</b> | <b>9109</b> | <b>123</b>         | <b>123</b> | <b>7810</b> | <b>7810</b> | <b>146</b>          | <b>146</b> | <b>4064</b> | <b>4064</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) <sup>^</sup> (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.