

Fecha de Publicación: 8 de octubre de 2018

Fecha de Información: 04 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\$2293.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<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	315.2	387.4	179.3	130.5	79.7	56.2	128.5
15-35	653.1	872.7	643.0	238.7	23.7	208.4	206.0
36-60	160.4	55.3	0.0	0.0	55.3	160.4	0.0
61-90	57.6	5.3	0.1	0.0	5.3	57.6	0.0
91-180	29.0	48.2	30.1	10.0	8.2	9.0	10.0
>180	32.0	26.2	8.0	0.0	13.2	27.0	5.0
<b>Total</b>	<b>1247.3</b>	<b>1395.2</b>	<b>860.4</b>	<b>379.2</b>	<b>185.3</b>	<b>518.6</b>	<b>349.5</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	2.0 %	1.9 %	1.3 %	1.7 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.4 %	1.6 %
36-60	-	1.5 %	1.3 %	1.3 %
61-90	-	1.8 %	1.3 %	1.4 %
91-180	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.6 %	2.1 %	1.5 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.6 %</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	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**	34	118	5604	5573	40	106	4948	4972	26	130	2854	2841
Intragruppo y off-shore***	0	0	2858	2177	0	0	2126	1345	0	0	1134	1007
Otros	118	34	1216	1929	106	40	1491	2249	130	26	932	1072
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>9678</b>	<b>9678</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>8566</b>	<b>8566</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>4920</b>	<b>4920</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 intragruppo.