

Fecha de Publicación: 9 de octubre de 2018

Fecha de Información: 05 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\$1271.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	230.4	313.7	102.5	31.0	23.2	11.4	188.0
15-35	445.0	336.8	148.8	112.0	54.1	199.0	134.0
36-60	110.6	97.5	0.0	0.0	97.5	110.6	0.0
61-90	5.3	10.9	0.0	0.0	10.9	5.3	0.0
91-180	1.7	9.6	0.0	0.0	9.6	1.7	0.0
>180	20.1	11.5	0.0	0.0	11.5	20.1	0.0
<b>Total</b>	<b>813.1</b>	<b>780.1</b>	<b>251.3</b>	<b>143.0</b>	<b>206.8</b>	<b>348.1</b>	<b>322.0</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	1.8 %	1.5 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.9 %
91-180	-	1.9 %	1.2 %	1.8 %
>180	-	2.0 %	1.6 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.7 %</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**	34	115	5604	5573	40	111	5109	5218	27	133	2923	2904
Intragruppo y off-shore***	0	0	2858	2177	0	0	2229	1376	0	0	1134	1007
Otros	115	34	1217	1929	111	40	1511	2254	133	27	932	1078
<b>Total</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>9679</b>	<b>9679</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>8848</b>	<b>8848</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>4989</b>	<b>4989</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.