

Fecha de Publicación: 29 de octubre de 2018

Fecha de Información: 25 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\$1950.9 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	380.1	491.9	264.5	166.0	45.2	31.9	182.2
15-35	494.9	618.2	313.3	131.3	132.8	191.4	172.2
36-60	109.6	130.5	4.0	0.0	79.5	62.6	47.0
61-90	21.5	0.8	0.0	20.0	0.8	1.5	0.0
91-180	28.0	51.7	25.0	0.3	6.7	7.7	20.0
>180	19.4	25.8	0.0	0.0	25.8	19.4	0.0
<b>Total</b>	<b>1053.4</b>	<b>1319.0</b>	<b>606.8</b>	<b>317.5</b>	<b>290.8</b>	<b>314.4</b>	<b>421.4</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	1.6 %	1.4 %	1.4 %	1.5 %
15-35	1.6 %	2.1 %	1.4 %	1.8 %
36-60	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	2.0 %	0.9 %	1.3 %
91-180	1.4 %	1.4 %	0.9 %	1.4 %
>180	-	1.5 %	1.3 %	1.4 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</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

Sectores	22 al 26 de octubre				29 de oct. al 2 de noviembre				5 al 9 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	155	4514	5059	32	143	5179	5628	29	82	3331	3821
Intragruppo y off-shore***	0	0	2375	1670	0	0	2666	1679	0	0	1956	759
Otros	155	27	1245	1405	143	32	1323	1861	82	29	781	1488
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>8134</b>	<b>8134</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>9168</b>	<b>9168</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>6068</b>	<b>6068</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.