

Fecha de Publicación: 1 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 30 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\$2019.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	321.2	144.4	42.5	194.5	31.9	56.7	70.0
15-35	647.2	908.3	373.0	56.8	129.3	184.5	406.0
36-60	171.9	29.2	0.0	20.0	9.2	131.9	20.0
61-90	5.9	6.4	0.0	0.0	6.4	5.9	0.0
91-180	48.2	72.0	0.0	35.0	67.0	8.2	5.0
>180	160.2	106.2	0.0	52.1	6.0	7.9	100.2
<b>Total</b>	<b>1354.6</b>	<b>1266.5</b>	<b>415.5</b>	<b>358.3</b>	<b>249.8</b>	<b>395.1</b>	<b>601.2</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 %	1.7 %	-1.2 %	-0.2 %
15-35	1.6 %	1.9 %	1.4 %	1.7 %
36-60	1.6 %	2.3 %	1.4 %	1.5 %
61-90	-	1.5 %	1.1 %	1.3 %
91-180	1.4 %	2.0 %	1.3 %	1.7 %
>180	1.6 %	1.5 %	1.4 %	1.6 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>0.5 %</b>	<b>1.3 %</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	29 de oct. al 2 de noviembre				5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	34	152	5720	5951	58	82	3496	4007	37	117	3837	4007
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2839	2072	0	0	1995	788	0	0	1411	700
<b>Otros</b>	152	34	1380	1916	82	58	808	1503	117	37	1627	2168
<b>Total</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>9938</b>	<b>9938</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>6298</b>	<b>6298</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>6875</b>	<b>6875</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.