

Fecha de Publicación: 8 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 06 de noviembre 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\$2909.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<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	810.8	267.7	111.0	664.2	81.7	71.5	75.0
15-35	451.3	994.1	826.9	169.5	95.7	210.3	71.5
36-60	49.5	49.1	20.0	0.0	14.1	34.5	15.0
61-90	43.7	21.1	0.0	0.0	21.1	43.7	0.0
91-180	97.6	89.5	20.0	45.0	69.5	52.6	0.0
>180	122.5	193.8	55.1	0.0	18.7	2.5	120.0
<b>Total</b>	<b>1575.3</b>	<b>1615.3</b>	<b>1033.0</b>	<b>878.7</b>	<b>300.8</b>	<b>415.1</b>	<b>281.5</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	1.5 %	1.6 %	1.1 %	1.3 %
15-35	1.6 %	1.5 %	1.5 %	1.5 %
36-60	1.5 %	1.4 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	1.6 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	1.5 %	1.3 %	1.4 %
>180	1.7 %	1.5 %	1.4 %	1.6 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.4 %</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	5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	57	98	4346	4292	50	125	4435	4786	26	134	3297	3969
Intragruppo y off-shore***	0	0	2108	1446	0	0	1728	915	0	0	1931	1065
Otros	98	57	863	1579	125	50	1884	2346	134	26	1033	1228
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>7317</b>	<b>7317</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>8047</b>	<b>8047</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>6261</b>	<b>6261</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.