

**Fecha de Publicación: 7 de diciembre de 2018**

**Fecha de Información: 05 de diciembre 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\$1660.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	376.9	209.2	47.5	240.7	73.9	48.4	87.8
15-35	442.3	499.4	242.5	156.2	29.4	58.6	227.5
36-60	47.1	99.1	0.0	0.0	99.1	47.1	0.0
61-90	104.3	137.7	0.0	0.0	137.7	104.3	0.0
91-180	2.8	19.1	0.0	0.0	19.1	2.8	0.0
>180	7.7	35.3	0.0	0.0	30.3	2.7	5.0
<b>Total</b>	<b>981.2</b>	<b>999.9</b>	<b>290.0</b>	<b>396.9</b>	<b>389.6</b>	<b>264.0</b>	<b>320.3</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	
3-14	2.0 %	1.7 %	2.7 %	2.3 %
15-35	1.8 %	1.9 %	1.8 %	1.9 %
36-60	-	1.9 %	1.8 %	1.9 %
61-90	-	2.1 %	1.6 %	1.9 %
91-180	-	1.8 %	1.3 %	1.8 %
>180	1.5 %	1.9 %	1.3 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.0 %</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	3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	53	130	4679	5122	45	142	5668	6276	56	203	3526	4842
Intragrupo y off-shore***	0	0	2451	1836	0	0	2254	1030	0	0	2672	1434
Otros	130	53	1353	1525	142	45	2154	2770	203	56	700	622
<b>Total</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>8484</b>	<b>8484</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>10076</b>	<b>10076</b>	<b>259</b>	<b>259</b>	<b>6898</b>	<b>6898</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.