

Fecha de Publicación: 10 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 06 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\$2154.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.9%.<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	571.9	276.6	120.7	431.7	66.9	51.2	89.0
15-35	297.7	518.7	422.5	132.3	29.7	98.9	66.5
36-60	80.9	94.3	12.0	0.0	82.3	80.9	0.0
61-90	113.4	119.4	64.3	10.0	53.1	101.4	2.0
91-180	45.5	69.2	55.0	40.0	14.2	5.5	0.0
>180	103.6	82.3	0.0	41.2	21.1	1.2	61.2
<b>Total</b>	<b>1213.0</b>	<b>1160.5</b>	<b>674.5</b>	<b>655.2</b>	<b>267.3</b>	<b>339.1</b>	<b>218.7</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	2.2 %	3.4 %	1.7 %	2.3 %
15-35	1.8 %	1.8 %	1.7 %	1.8 %
36-60	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.5 %	1.7 %	1.6 %	1.6 %
91-180	-	1.6 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.7 %	1.9 %	1.5 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.9 %</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	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**	54	131	4809	5202	45	144	5936	6369	54	202	3710	4980
Intragrupa y off-shore***	0	0	2466	1897	0	0	2284	1246	0	0	2770	1589
Otros	131	54	1358	1535	144	45	2198	2803	202	54	719	631
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>8633</b>	<b>8633</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>10418</b>	<b>10418</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>7199</b>	<b>7199</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.