

Fecha de Publicación: 20 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 16 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\$1668.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	334.4	227.8	66.5	211.0	64.3	26.4	97.0
15-35	458.6	595.7	407.6	266.0	55.6	60.1	132.5
36-60	9.2	22.2	10.0	0.0	7.2	4.2	5.0
61-90	79.5	59.0	0.0	0.0	54.0	74.5	5.0
91-180	40.6	25.7	0.0	39.0	25.7	1.6	0.0
>180	30.3	44.7	20.0	10.0	4.7	0.3	20.0
<b>Total</b>	<b>952.5</b>	<b>975.1</b>	<b>504.1</b>	<b>526.0</b>	<b>211.5</b>	<b>167.0</b>	<b>259.5</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	2.6 %	2.0 %	1.0 %	1.6 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.8 %	1.8 %
36-60	1.8 %	1.9 %	1.5 %	1.8 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.9 %	1.6 %	1.7 %
>180	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>2.1 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.7 %</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	12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	141	5428	5449	33	145	4016	4682	23	146	4619	4952
Intragruppo y off-shore***	0	0	2116	1630	0	0	2305	1445	0	0	1884	1115
Otros	141	52	1933	2398	145	33	1109	1302	146	23	1210	1646
<b>Total</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>9477</b>	<b>9477</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>7429</b>	<b>7429</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>7714</b>	<b>7714</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.