

Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 21 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\$2018.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	254.8	245.4	115.8	143.0	36.6	18.8	93.0
15-35	498.8	684.7	352.2	151.0	200.5	215.8	132.0
36-60	61.0	106.0	70.0	30.0	6.0	1.0	30.0
61-90	85.9	153.5	40.0	18.0	103.5	57.9	10.0
91-180	68.4	49.2	6.1	47.0	23.1	1.4	20.0
>180	59.2	42.7	0.0	25.3	36.0	27.2	6.7
<b>Total</b>	<b>1028.2</b>	<b>1281.6</b>	<b>584.1</b>	<b>414.3</b>	<b>405.8</b>	<b>322.2</b>	<b>291.7</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	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
15-35	1.9 %	1.9 %	1.5 %	1.7 %
36-60	1.6 %	4.6 %	1.5 %	1.8 %
61-90	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
91-180	1.5 %	1.9 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.5 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.5 %</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

Sector	19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	34	150	4737	5006	27	149	4926	5303	26	120	3410	4532
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2384	1943	0	0	2127	1287	0	0	2142	843
<b>Otros</b>	150	34	1138	1311	149	27	1240	1702	120	26	1248	1426
<b>Total</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>8259</b>	<b>8259</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>8293</b>	<b>8293</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>6801</b>	<b>6801</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.