

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 22 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\$260.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	106.9	110.6	10.0	4.0	5.6	7.9	95.0
15-35	104.7	116.5	7.0	9.0	14.5	0.7	95.0
36-60	0.1	1.3	0.3	0.0	0.9	0.1	0.0
61-90	0.4	0.7	0.0	0.0	0.7	0.4	0.0
91-180	0.8	3.9	0.0	0.0	3.9	0.8	0.0
>180	2.2	1.9	0.0	0.0	1.9	2.2	0.0
<b>Total</b>	<b>215.2</b>	<b>234.8</b>	<b>17.3</b>	<b>13.0</b>	<b>27.5</b>	<b>12.2</b>	<b>190.0</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	1.3 %	2.6 %	0.9 %	1.4 %
15-35	1.8 %	4.2 %	1.6 %	2.1 %
36-60	-	3.0 %	1.2 %	2.8 %
61-90	-	2.2 %	1.4 %	1.9 %
91-180	-	1.8 %	1.2 %	1.7 %
>180	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>3.1 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.8 %</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	153	4767	5029	26	152	4996	5380	28	120	3415	4533
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2384	1943	0	0	2137	1287	0	0	2142	847
<b>Otros</b>	153	34	1136	1316	152	26	1237	1702	120	28	1249	1426
<b>Total</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>8287</b>	<b>8287</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>8370</b>	<b>8370</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>6806</b>	<b>6806</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.