

Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 27 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\$2171.6 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	341.0	277.2	159.8	226.2	30.4	27.8	87.0
15-35	458.7	724.4	433.1	190.5	39.8	16.7	251.5
36-60	51.8	88.9	40.0	0.0	7.3	10.2	41.6
61-90	242.1	83.1	0.0	0.0	83.1	242.1	0.0
91-180	181.1	108.8	0.0	106.0	53.8	20.1	55.0
>180	26.4	33.3	16.6	0.0	6.6	16.4	10.0
<b>Total</b>	<b>1301.1</b>	<b>1315.6</b>	<b>649.5</b>	<b>522.8</b>	<b>221.1</b>	<b>333.2</b>	<b>445.1</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	1.9 %	2.2 %	1.6 %	1.9 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
61-90	-	1.7 %	1.5 %	1.5 %
91-180	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.6 %</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	26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre				10 al 14 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	171	5541	5861	34	120	3631	4714	27	124	5082	5655
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2467	1662	0	0	2208	919	0	0	2055	878
<b>Otros</b>	171	34	1253	1738	120	34	1257	1463	124	27	1976	2581
<b>Total</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>9261</b>	<b>9261</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>7096</b>	<b>7096</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>9114</b>	<b>9114</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 intragruppo.