

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2018

Fecha de Información: 28 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\$2228.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.8%.<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	440.7	400.2	227.5	235.3	66.4	99.1	106.3
15-35	484.4	644.8	345.3	179.7	58.8	64.0	240.7
36-60	74.5	10.7	2.7	25.0	8.0	49.5	0.0
61-90	271.8	205.1	40.0	31.7	110.1	185.1	55.0
91-180	7.6	34.3	20.0	2.0	14.3	5.6	0.0
>180	51.5	42.7	0.0	0.0	5.3	14.0	37.5
<b>Total</b>	<b>1330.5</b>	<b>1337.8</b>	<b>635.5</b>	<b>473.7</b>	<b>262.9</b>	<b>417.3</b>	<b>439.5</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.6 %	1.5 %	1.6 %	1.6 %
15-35	2.1 %	2.1 %	2.0 %	2.1 %
36-60	-	2.1 %	1.2 %	1.3 %
61-90	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
91-180	-	1.4 %	1.3 %	1.3 %
>180	1.5 %	1.8 %	1.5 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.7 %</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
Sector Financiero**	33	173	5754	5993	55	124	3680	4846	36	126	5238	5798
Intragrupa y off-shore***	0	0	2524	1812	0	0	2318	954	0	0	2118	928
Otros	173	33	1272	1745	124	55	1279	1477	126	36	2006	2636
<b>Total</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>9550</b>	<b>9550</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>7277</b>	<b>7277</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>9362</b>	<b>9362</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.