

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 12 de diciembre 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\$2585.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.<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	310.1	200.0	89.9	134.9	35.6	100.7	74.5
15-35	491.4	492.6	269.0	153.5	77.6	191.9	146.0
36-60	130.7	81.6	0.0	51.0	81.6	79.8	0.0
61-90	343.1	320.6	73.0	80.0	171.6	187.1	76.0
91-180	317.0	161.6	27.0	0.0	134.6	317.0	0.0
>180	29.0	17.9	0.0	13.4	3.9	1.6	14.0
<b>Total</b>	<b>1621.3</b>	<b>1274.3</b>	<b>458.9</b>	<b>432.8</b>	<b>504.8</b>	<b>878.0</b>	<b>310.5</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	2.3 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
15-35	1.8 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	1.8 %	1.6 %	1.7 %
61-90	1.4 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
91-180	-	1.7 %	1.5 %	1.5 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.6 %</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	10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	46	154	7359	7047	63	212	4275	5383	15	164	2063	2431
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2538	2189	0	0	3003	1982	0	0	1230	959
<b>Otros</b>	154	46	2285	2945	212	63	819	732	164	15	401	304
<b>Total</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>12182</b>	<b>12182</b>	<b>275</b>	<b>275</b>	<b>8097</b>	<b>8097</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>3694</b>	<b>3694</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 intragrupo.