

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 13 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\$1945.1 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	299.9	125.4	48.6	220.6	21.8	24.3	55.0
15-35	293.1	632.3	471.3	129.3	45.5	48.3	115.5
36-60	322.3	143.9	0.0	0.0	93.9	272.3	50.0
61-90	51.0	70.4	0.0	0.0	70.4	51.0	0.0
91-180	43.4	46.0	22.9	30.0	13.1	3.4	10.0
>180	110.6	146.6	34.0	0.0	3.3	1.2	109.4
<b>Total</b>	<b>1120.3</b>	<b>1164.7</b>	<b>576.8</b>	<b>379.9</b>	<b>247.9</b>	<b>400.6</b>	<b>339.9</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	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.5 %
61-90	-	1.6 %	1.5 %	1.5 %
91-180	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
>180	1.6 %	1.6 %	1.5 %	1.6 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.5 %</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

Sector	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>	44	153	7485	7105	66	214	4436	5441	15	163	2088	2438
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2564	2285	0	0	3026	2107	0	0	1230	972
<b>Otros</b>	153	44	2292	2950	214	66	825	739	163	15	408	316
<b>Total</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>12340</b>	<b>12340</b>	<b>279</b>	<b>279</b>	<b>8287</b>	<b>8287</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>3725</b>	<b>3725</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.