

Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 14 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\$1707.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<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	470.8	227.7	80.5	228.9	33.5	128.2	113.8
15-35	292.7	615.0	424.6	129.5	37.0	9.7	153.5
36-60	64.8	73.7	0.0	0.0	73.7	64.8	0.0
61-90	98.1	100.1	62.0	45.0	8.1	23.1	30.0
91-180	4.9	7.3	0.0	0.0	7.3	4.9	0.0
>180	17.9	46.3	30.7	0.0	0.6	2.9	15.0
<b>Total</b>	<b>949.3</b>	<b>1070.0</b>	<b>597.7</b>	<b>403.4</b>	<b>160.0</b>	<b>233.7</b>	<b>312.3</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 %	4.8 %	-0.3 %	0.8 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.6 %	1.7 %
36-60	-	2.0 %	1.4 %	1.7 %
61-90	1.5 %	1.5 %	1.6 %	1.5 %
91-180	-	2.0 %	1.2 %	1.7 %
>180	1.5 %	1.6 %	1.3 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>0.5 %</b>	<b>1.4 %</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	7484	7105	158	206	4797	5656	18	163	2106	2446
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2564	2285	0	0	3107	2330	0	0	1230	978
<b>Otros</b>	153	44	2292	2949	206	158	856	773	163	18	407	318
<b>Total</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>12339</b>	<b>12339</b>	<b>364</b>	<b>364</b>	<b>8759</b>	<b>8759</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>3742</b>	<b>3742</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.