

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2018

Fecha de Información: 17 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\$780.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<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	151.4	130.5	92.5	68.3	10.0	55.1	28.0
15-35	201.8	235.0	100.0	50.0	6.5	23.3	128.5
36-60	14.9	51.0	0.0	8.5	48.0	3.4	3.0
61-90	67.4	38.7	0.0	0.0	38.7	67.4	0.0
91-180	6.5	36.8	22.8	0.0	14.0	6.5	0.0
>180	2.5	3.4	0.0	2.5	3.4	0.1	0.0
<b>Total</b>	<b>444.6</b>	<b>495.3</b>	<b>215.4</b>	<b>129.3</b>	<b>120.5</b>	<b>155.8</b>	<b>159.5</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	1.7 %	1.9 %	-0.6 %	0.4 %
15-35	1.6 %	1.7 %	1.5 %	1.6 %
36-60	1.5 %	1.7 %	1.3 %	1.7 %
61-90	-	1.6 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	1.9 %	1.3 %	1.7 %
>180	-	1.9 %	0.5 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>0.6 %</b>	<b>1.3 %</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	17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	207	209	4893	5774	18	158	2111	2464	1	47	1702	1825
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	3191	2394	0	0	1238	982	0	0	967	835
<b>Otros</b>	209	207	861	777	158	18	416	319	47	1	149	157
<b>Total</b>	<b>416</b>	<b>416</b>	<b>8945</b>	<b>8945</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>3766</b>	<b>3766</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>2818</b>	<b>2818</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.