

Fecha de Publicación: 3 de enero de 2019

Fecha de Información: 28 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\$992.5 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	135.7	35.8	1.2	109.2	19.6	11.6	15.0
15-35	201.2	288.0	136.2	70.3	90.9	69.9	61.0
36-60	65.8	84.7	70.0	50.0	14.7	15.8	0.0
61-90	14.7	30.4	0.0	4.0	20.4	0.7	10.0
91-180	144.4	50.5	0.0	20.0	20.5	94.4	30.0
>180	40.2	47.0	10.0	10.0	7.0	0.2	30.0
<b>Total</b>	<b>602.1</b>	<b>536.4</b>	<b>217.3</b>	<b>263.4</b>	<b>173.1</b>	<b>192.7</b>	<b>146.0</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	2.0 %	2.4 %	1.7 %	2.0 %
15-35	1.8 %	2.2 %	1.6 %	1.9 %
36-60	-	2.0 %	1.7 %	1.9 %
61-90	1.6 %	2.0 %	0.5 %	1.9 %
91-180	1.7 %	0.9 %	1.5 %	1.5 %
>180	1.6 %	1.7 %	0.5 %	1.6 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>1.6 %</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	24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	24	139	2533	2661	28	57	1903	2308	20	86	2784	3691
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1284	1260	0	0	1340	920	0	0	2294	1118
<b>Otros</b>	139	24	477	373	57	28	168	182	86	20	318	587
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>4294</b>	<b>4294</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>3410</b>	<b>3410</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>5396</b>	<b>5396</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.