

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 28 de noviembre de 2017 <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\$1778.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.<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	159.3	288.1	181.3	46.8	23.5	29.2	83.3
15-35	389.5	275.3	106.3	196.5	8.1	32.0	161.0
36-60	261.1	168.9	0.0	0.0	168.9	261.1	0.0
61-90	225.7	188.1	57.0	40.0	121.1	175.7	10.0
91-180	17.6	25.0	0.0	0.0	25.0	17.6	0.0
>180	10.7	27.8	0.0	0.0	23.8	6.7	4.0
<b>Total</b>	<b>1063.9</b>	<b>973.3</b>	<b>344.5</b>	<b>283.3</b>	<b>370.4</b>	<b>522.4</b>	<b>258.3</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	-3.1 %	4.7 %	3.6 %	2.4 %
15-35	3.6 %	3.7 %	3.5 %	3.6 %
36-60	-	3.3 %	3.1 %	3.2 %
61-90	3.2 %	3.1 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-	3.1 %	2.7 %	2.9 %
>180	2.8 %	2.8 %	2.6 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.2 %</b>	<b>3.1 %</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	27 de nov. al 1 de diciembre				4 al 8 de diciembre				11 al 15 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	25	171	5714	5795	12	105	3670	3962	14	128	3276	3318
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2581	1836	0	0	2021	1049	0	0	1457	807
<b>Otros</b>	171	25	1547	2211	105	12	829	1509	128	14	903	1511
<b>Total</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>9842</b>	<b>9842</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>6520</b>	<b>6520</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>5636</b>	<b>5636</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.