

Fecha de Publicación: 6 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 04 de diciembre 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\$1867.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	375.1	251.8	78.3	210.6	35.5	26.4	138.0
15-35	304.8	503.6	339.3	138.0	10.2	12.8	154.0
36-60	126.6	249.2	80.0	0.0	61.0	18.4	108.2
61-90	220.4	116.1	0.0	0.0	86.1	190.4	30.0
91-180	0.1	56.2	30.0	0.0	26.2	0.1	0.0
>180	75.0	43.7	0.0	50.0	18.7	0.0	25.0
<b>Total</b>	<b>1101.9</b>	<b>1220.4</b>	<b>527.6</b>	<b>398.6</b>	<b>237.6</b>	<b>248.0</b>	<b>455.2</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 %	3.7 %	3.4 %	1.4 %
15-35	3.7 %	3.8 %	3.6 %	3.7 %
36-60	3.4 %	3.5 %	3.2 %	3.4 %
61-90	2.9 %	3.3 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-	3.1 %	2.7 %	3.1 %
>180	2.3 %	2.7 %	2.6 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.2 %</b>	<b>3.0 %</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

Sectores	4 al 8 de diciembre				11 al 15 de diciembre				18 al 22 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	131	4368	4361	21	136	3466	3697	20	152	3018	3391
Intragruppo y off-shore***	0	0	2156	1451	0	0	1677	823	0	0	1851	1470
Otros	131	20	859	1572	136	21	937	1561	152	20	482	490
<b>Total</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>7383</b>	<b>7383</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>6081</b>	<b>6081</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>5351</b>	<b>5351</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.