

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 19 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\$1225.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<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	145.2	162.5	65.0	51.8	16.5	12.4	81.0
15-35	561.7	397.4	149.6	282.5	113.4	144.7	134.5
36-60	2.3	31.9	0.0	0.0	31.9	2.3	0.0
61-90	37.1	28.3	2.0	30.0	20.3	1.1	6.0
91-180	3.2	25.5	0.0	0.0	25.5	3.2	0.0
>180	0.2	51.8	32.9	0.0	18.9	0.2	0.0
<b>Total</b>	<b>749.7</b>	<b>697.5</b>	<b>249.5</b>	<b>364.3</b>	<b>226.5</b>	<b>163.9</b>	<b>221.5</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	3.8 %	4.6 %	2.5 %	3.7 %
15-35	2.8 %	3.7 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.4 %	2.7 %	3.4 %
61-90	3.1 %	3.4 %	3.0 %	3.2 %
91-180	-	3.2 %	2.6 %	3.2 %
>180	-	2.8 %	2.4 %	2.8 %
<b>Total</b>	<b>3.2 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.2 %</b>	<b>3.4 %</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

Sectores	18 al 22 de diciembre				25 al 29 de diciembre				1 al 5 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	198	4076	4502	14	104	1816	2255	2	58	2280	2749
Intragruppo y off-shore***	0	0	2486	1915	0	0	1266	855	0	0	1480	1027
Otros	198	28	558	703	104	14	376	348	58	2	165	149
<b>Total</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>7120</b>	<b>7120</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>3458</b>	<b>3458</b>	<b>59</b>	<b>59</b>	<b>3925</b>	<b>3925</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.