

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 22 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\$501.1 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         | 63.8                | 48.4         | 24.0                       | 40.0         | 14.4          | 13.8        | 10.0           |
| 15-35        | 54.7                | 102.5        | 75.8                       | 20.0         | 21.7          | 29.7        | 5.0            |
| 36-60        | 18.9                | 17.9         | 0.0                        | 10.2         | 10.9          | 1.7         | 7.0            |
| 61-90        | 35.0                | 77.0         | 30.0                       | 0.0          | 13.0          | 1.0         | 34.0           |
| 91-180       | 35.3                | 74.2         | 35.6                       | 30.0         | 35.7          | 2.3         | 3.0            |
| >180         | 10.5                | 32.0         | 3.0                        | 0.0          | 19.0          | 0.5         | 10.0           |
| <b>Total</b> | <b>218.2</b>        | <b>352.0</b> | <b>168.3</b>               | <b>100.2</b> | <b>114.6</b>  | <b>48.9</b> | <b>69.0</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 intragruppo |              | Total        |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas     | Compras                       | Ventas       |              |
| 3-14         | 3.3 %              | 4.7 %                         | 3.1 %        | 3.7 %        |
| 15-35        | 3.3 %              | 3.3 %                         | 3.1 %        | 3.2 %        |
| 36-60        | 3.1 %              | 3.6 %                         | 2.9 %        | 3.4 %        |
| 61-90        | -0.1 %             | 3.3 %                         | 2.8 %        | 1.8 %        |
| 91-180       | 2.9 %              | 3.2 %                         | 2.9 %        | 3.1 %        |
| >180         | 2.8 %              | 3.2 %                         | 2.3 %        | 3.0 %        |
| <b>Total</b> | <b>1.5 %</b>       | <b>3.4 %</b>                  | <b>3.1 %</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                   | 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                    | 208        | 4234        | 4586        | 18                    | 102        | 2028        | 2342        | 4               | 54        | 2377        | 2854        |
| Intragruppo y off-shore*** | 0                     | 0          | 2525        | 2029        | 0                     | 0          | 1291        | 1004        | 0               | 0         | 1520        | 1070        |
| Otros                      | 208                   | 28         | 561         | 704         | 102                   | 18         | 419         | 393         | 54              | 4         | 199         | 172         |
| <b>Total</b>               | <b>237</b>            | <b>237</b> | <b>7319</b> | <b>7319</b> | <b>120</b>            | <b>120</b> | <b>3739</b> | <b>3739</b> | <b>58</b>       | <b>58</b> | <b>4096</b> | <b>4096</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 intragruppo.