

Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 26 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\$655.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.<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         | 54.4                | 121.0        | 97.3                      | 30.0        | 1.7           | 2.4         | 22.0           |
| 15-35        | 181.4               | 320.5        | 218.2                     | 58.0        | 37.2          | 58.4        | 65.0           |
| 36-60        | 0.9                 | 4.5          | 0.0                       | 0.0         | 4.5           | 0.9         | 0.0            |
| 61-90        | 0.4                 | 12.7         | 0.0                       | 0.0         | 12.7          | 0.4         | 0.0            |
| 91-180       | 9.8                 | 22.4         | 0.0                       | 1.2         | 22.4          | 8.6         | 0.0            |
| >180         | 0.0                 | 14.2         | 0.0                       | 0.0         | 14.2          | 0.0         | 0.0            |
| <b>Total</b> | <b>247.0</b>        | <b>495.2</b> | <b>315.5</b>              | <b>89.2</b> | <b>92.7</b>   | <b>70.7</b> | <b>87.0</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         | 4.2 %              | 5.0 %                        | 3.8 %        | 4.6 %        |
| 15-35        | 3.3 %              | 3.7 %                        | 3.2 %        | 3.4 %        |
| 36-60        | -                  | 4.2 %                        | 3.0 %        | 4.0 %        |
| 61-90        | -                  | 3.3 %                        | 2.9 %        | 3.3 %        |
| 91-180       | -                  | 2.6 %                        | 2.7 %        | 2.7 %        |
| >180         | -                  | 2.8 %                        | -            | 2.8 %        |
| <b>Total</b> | <b>3.5 %</b>       | <b>3.9 %</b>                 | <b>3.3 %</b> | <b>3.7 %</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                    | 25 al 29 de diciembre |            |             |             | 1 al 5 de enero |           |             |             | 8 al 12 de enero |            |             |             |
|---------------------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|-----------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
|                           | Delivery              |            | NDF         |             | Delivery        |           | NDF         |             | Delivery         |            | NDF         |             |
|                           | C                     | V          | C           | V           | C               | V         | C           | V           | C                | V          | C           | V           |
| Sector Financiero**       | 18                    | 107        | 2069        | 2370        | 4               | 55        | 2389        | 2885        | 5                | 100        | 2536        | 3559        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                     | 0          | 1307        | 1034        | 0               | 0         | 1544        | 1070        | 0                | 0          | 1872        | 500         |
| Otros                     | 107                   | 18         | 416         | 389         | 55              | 4         | 199         | 177         | 100              | 5          | 432         | 782         |
| <b>Total</b>              | <b>125</b>            | <b>125</b> | <b>3793</b> | <b>3793</b> | <b>59</b>       | <b>59</b> | <b>4132</b> | <b>4132</b> | <b>105</b>       | <b>105</b> | <b>4840</b> | <b>4840</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.