

**Fecha de Publicación: 9 de enero de 2018**

**Fecha de Información: 04 de enero de 2018 <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\$1684.7 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	319.6	299.3	40.0	82.5	35.3	13.1	224.0
15-35	703.2	677.7	154.5	303.3	148.1	24.9	375.0
36-60	28.9	23.9	0.0	8.6	23.9	20.3	0.0
61-90	10.2	32.0	0.0	4.5	32.0	5.7	0.0
91-180	30.1	63.1	6.4	30.0	56.7	0.1	0.0
>180	33.8	85.8	0.0	10.0	62.0	0.0	23.8
<b>Total</b>	<b>1125.8</b>	<b>1181.7</b>	<b>200.9</b>	<b>438.9</b>	<b>358.0</b>	<b>64.2</b>	<b>622.8</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 %	2.7 %	3.1 %	3.0 %
15-35	3.0 %	3.2 %	2.8 %	3.0 %
36-60	3.5 %	3.8 %	2.8 %	3.3 %
61-90	-	3.7 %	2.7 %	3.5 %
91-180	-	3.4 %	1.6 %	3.1 %
>180	2.7 %	2.9 %	2.7 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.0 %</b>	<b>3.2 %</b>	<b>2.8 %</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.

<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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	1 al 5 de enero				8 al 12 de enero				15 al 19 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	16	57	3068	3159	16	115	2983	3950	33	89	3780	3378
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1601	1571	0	0	1942	667	0	0	1286	1191
<b>Otros</b>	57	16	256	195	115	16	543	850	89	33	1019	1515
<b>Total</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>4925</b>	<b>4925</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>5467</b>	<b>5467</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>6084</b>	<b>6084</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.