

Fecha de Publicación: 1 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 29 de noviembre 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\$2117.7 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	386.4	178.7	59.0	247.0	10.4	30.1	109.3
15-35	491.8	741.0	455.0	186.0	37.3	57.1	248.8
36-60	160.4	139.9	30.0	0.0	79.9	130.4	30.0
61-90	199.1	114.7	0.0	0.0	109.7	194.1	5.0
91-180	6.5	17.3	0.0	0.0	11.3	0.5	6.0
>180	32.4	70.4	30.0	10.0	18.4	0.4	22.0
<b>Total</b>	<b>1276.6</b>	<b>1262.0</b>	<b>574.0</b>	<b>443.0</b>	<b>267.0</b>	<b>412.6</b>	<b>421.0</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	9.0 %	3.7 %	3.7 %	5.0 %
15-35	3.6 %	3.6 %	3.6 %	3.6 %
36-60	3.1 %	3.3 %	3.1 %	3.2 %
61-90	3.2 %	3.3 %	3.0 %	3.1 %
91-180	3.1 %	3.2 %	2.7 %	3.1 %
>180	2.7 %	2.7 %	2.6 %	2.7 %
<b>Total</b>	<b>4.9 %</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.4 %</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	27 de nov. al 1 de diciembre				4 al 8 de diciembre				11 al 15 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	221	5987	5831	19	126	3758	4027	20	129	3345	3425
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2605	2045	0	0	2055	1087	0	0	1497	807
<b>Otros</b>	221	23	1496	2212	126	19	813	1512	129	20	915	1524
<b>Total</b>	<b>243</b>	<b>243</b>	<b>10088</b>	<b>10088</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>6626</b>	<b>6626</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>5756</b>	<b>5756</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.