

Fecha de Publicación: 5 de diciembre de 2017

Fecha de Información: 01 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\$1839.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.<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	264.5	187.6	72.5	168.1	30.1	11.4	85.0
15-35	488.5	703.9	425.0	190.0	12.0	31.4	267.0
36-60	171.2	135.4	58.6	0.0	76.7	171.1	0.0
61-90	82.6	141.4	75.0	0.0	31.4	47.6	35.0
91-180	0.8	12.7	0.0	0.0	12.7	0.8	0.0
>180	14.8	33.4	0.0	0.0	23.4	4.8	10.0
<b>Total</b>	<b>1022.3</b>	<b>1214.4</b>	<b>631.1</b>	<b>358.1</b>	<b>186.3</b>	<b>267.2</b>	<b>397.0</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	3.8 %	3.7 %	3.8 %	3.7 %
15-35	3.7 %	3.7 %	3.7 %	3.7 %
36-60	3.9 %	3.2 %	3.1 %	3.1 %
61-90	3.0 %	3.2 %	3.1 %	3.1 %
91-180	-	3.1 %	2.6 %	3.1 %
>180	2.6 %	3.1 %	2.0 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.5 %</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	201	6043	5881	20	125	4091	4261	20	135	3369	3563
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2615	2066	0	0	2150	1248	0	0	1615	815
<b>Otros</b>	201	23	1503	2214	125	20	839	1571	135	20	930	1536
<b>Total</b>	<b>223</b>	<b>223</b>	<b>10160</b>	<b>10160</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>7080</b>	<b>7080</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>5914</b>	<b>5914</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.