**Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2017**

**Fecha de Información: 21 de diciembre de 2017** [1]

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US$1106.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.[2]

**Cuadro No. 1**
**Contratos Forwards Pactados**

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 167.9 | 104.6 | 26.0 | 111.5 | 38.6 | 16.4 | 40.0 |
| 15-35 | 389.5 | 311.4 | 198.8 | 265.5 | 26.7 | 38.1 | 85.9 |
| 36-60 | 10.4 | 22.2 | 0.0 | 0.0 | 17.7 | 5.9 | 4.5 |
| 61-90 | 35.7 | 51.5 | 30.0 | 30.0 | 16.3 | 0.5 | 5.2 |
| 91-180 | 43.4 | 76.6 | 3.0 | 20.0 | 51.0 | 0.8 | 22.6 |
| >180 | 26.3 | 30.8 | 0.0 | 20.0 | 25.8 | 1.3 | 5.0 |
| **Total** | **673.0** | **597.0** | **257.8** | **447.0** | **176.1** | **62.9** | **163.2** |

* 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 | 3.4 % | 3.1 % | 3.3 % | 3.2 % |
| 15-35 | 2.9 % | 3.3 % | 3.1 % | 3.1 % |
| 36-60 | 3.2 % | 4.0 % | 0.8 % | 3.2 % |
| 61-90 | 3.1 % | 3.2 % | 3.1 % | 3.2 % |
| 91-180 | 3.0 % | 3.1 % | 3.0 % | 3.1 % |
| >180 | 2.8 % | 2.9 % | 2.8 % | 2.9 % |
| **Total** | 3.0 % | 3.2 % | 3.1 % | 3.1 % |

*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 | 17 | 103 | 1987 | 2316 | 2 | 57 | 2356 | 2831 |
| **Intragrupo y off-shore***** | 0 | 0 | 2525 | 2029 | 0 | 0 | 1277 | 964 | 0 | 0 | 1510 | 1070 |
| **Otros** | 208 | 28 | 561 | 704 | 103 | 17 | 408 | 392 | 57 | 2 | 196 | 161 |
| **Total** | **236** | **236** | **7319** | **7319** | **121** | **121** | **3672** | **3672** | **59** | **59** | **4062** | **4062** |

* 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.

[1] Datos provisionales.

[2] 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.