

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 28 de noviembre de 2017¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1778.9 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 | 159.3 | 288.1 | 181.3 | 46.8 | 23.5 | 29.2 | 83.3 |
| 15-35 | 389.5 | 275.3 | 106.3 | 196.5 | 8.1 | 32.0 | 161.0 |
| 36-60 | 261.1 | 168.9 | 0.0 | 0.0 | 168.9 | 261.1 | 0.0 |
| 61-90 | 225.7 | 188.1 | 57.0 | 40.0 | 121.1 | 175.7 | 10.0 |
| 91-180 | 17.6 | 25.0 | 0.0 | 0.0 | 25.0 | 17.6 | 0.0 |
| >180 | 10.7 | 27.8 | 0.0 | 0.0 | 23.8 | 6.7 | 4.0 |
| Total | 1063.9 | 973.3 | 344.5 | 283.3 | 370.4 | 522.4 | 258.3 |

* 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 % | | 4.7 % | 3.6 % | 2.4 % |
| 15-35 | 3.6 % | | 3.7 % | 3.5 % | 3.6 % |
| 36-60 | - | | 3.3 % | 3.1 % | 3.2 % |
| 61-90 | 3.2 % | | 3.1 % | 3.0 % | 3.1 % |
| 91-180 | - | | 3.1 % | 2.7 % | 2.9 % |
| >180 | 2.8 % | | 2.8 % | 2.6 % | 2.7 % |
| Total | 1.4 % | | 3.6 % | 3.2 % | 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 | 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 |
| Sector Financiero** | 25 | 171 | 5714 | 5795 | 12 | 105 | 3670 | 3962 | 14 | 128 | 3276 | 3318 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2581 | 1836 | 0 | 0 | 2021 | 1049 | 0 | 0 | 1457 | 807 |
| Otros | 171 | 25 | 1547 | 2211 | 105 | 12 | 829 | 1509 | 128 | 14 | 903 | 1511 |
| Total | 197 | 197 | 9842 | 9842 | 117 | 117 | 6520 | 6520 | 142 | 142 | 5636 | 5636 |

* 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.