

**Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2017**

**Fecha de Información: 06 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\$2095.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	224.5	172.5	73.0	96.8	22.5	50.8	77.0
15-35	672.1	815.4	422.0	283.2	17.5	13.1	375.9
36-60	83.8	121.2	69.0	0.0	52.2	83.8	0.0
61-90	272.1	78.3	0.0	10.0	43.3	227.1	35.0
91-180	18.2	32.0	25.0	10.0	7.0	8.2	0.0
>180	37.3	55.6	35.0	35.0	20.6	2.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1308.0</b>	<b>1274.9</b>	<b>624.0</b>	<b>434.9</b>	<b>163.0</b>	<b>385.3</b>	<b>487.9</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	3.7 %		3.9 %	3.3 %	3.5 %
15-35	3.7 %		3.6 %	3.6 %	3.7 %
36-60	-		3.5 %	3.3 %	3.4 %
61-90	3.2 %		3.3 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-		3.0 %	2.8 %	2.9 %
>180	-		2.8 %	2.7 %	2.8 %
<b>Total</b>	<b>3.7 %</b>		<b>3.5 %</b>	<b>3.2 %</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**

Sectores	4 al 8 de diciembre				11 al 15 de diciembre				18 al 22 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	135	4725	4450	32	136	3596	3887	25	152	3200	3614
Intragrupo y off-shore***	0	0	2191	1726	0	0	1772	841	0	0	1978	1563
Otros	135	18	861	1601	136	32	954	1595	152	25	498	500
<b>Total</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>7777</b>	<b>7777</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6322</b>	<b>6322</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>5676</b>	<b>5676</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.