

Fecha de Publicación: 4 de octubre de 2017

Fecha de Información: 02 de octubre 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\$1296.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.<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	216.0	264.4	83.0	46.0	70.4	59.0	111.0
15-35	388.3	322.9	126.5	76.3	93.3	209.1	103.0
36-60	149.9	74.2	0.0	0.0	74.2	149.9	0.0
61-90	4.7	8.0	0.0	0.0	8.0	4.7	0.0
91-180	13.3	10.9	0.0	10.0	10.9	3.3	0.0
>180	55.8	32.1	0.0	20.0	2.1	5.8	30.0
<b>Total</b>	<b>828.0</b>	<b>712.4</b>	<b>209.5</b>	<b>152.3</b>	<b>258.9</b>	<b>431.8</b>	<b>244.0</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	5.0 %	4.7 %	5.0 %	4.9 %
15-35	4.7 %	4.8 %	4.5 %	4.6 %
36-60	-	4.6 %	3.6 %	3.9 %
61-90	-	4.6 %	4.0 %	4.4 %
91-180	-	4.4 %	3.9 %	4.1 %
>180	3.8 %	4.1 %	3.7 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>4.7 %</b>	<b>4.7 %</b>	<b>4.3 %</b>	<b>4.5 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	2 al 6 de octubre				9 al 13 de octubre				16 al 20 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	28	157	4819	5173	8	105	4255	4195	18	147	2697	2678
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2153	1126	0	0	1654	1103	0	0	1181	865
<b>Otros</b>	157	28	990	1662	105	8	1104	1715	147	18	849	1185
<b>Total</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>7962</b>	<b>7962</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>7013</b>	<b>7013</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>4728</b>	<b>4728</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.