

Fecha de Publicación: 13 de octubre de 2017

Fecha de Información: 11 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\$2096.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	399.9	392.1	150.0	107.0	10.1	60.9	232.0
15-35	499.7	499.4	199.8	182.0	155.6	173.7	144.0
36-60	273.9	156.6	0.0	0.0	156.6	273.9	0.0
61-90	82.4	44.2	0.0	30.0	4.2	12.4	40.0
91-180	53.2	39.7	0.0	24.9	14.7	3.3	25.0
>180	72.5	78.6	20.0	16.3	3.6	1.3	55.0
<b>Total</b>	<b>1381.6</b>	<b>1210.7</b>	<b>369.8</b>	<b>360.1</b>	<b>344.9</b>	<b>525.5</b>	<b>496.0</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	5.5 %	5.0 %	4.5 %	5.1 %
15-35	4.7 %	4.3 %	4.2 %	4.3 %
36-60	-	4.7 %	4.5 %	4.6 %
61-90	4.2 %	4.6 %	4.0 %	4.1 %
91-180	4.1 %	4.2 %	4.1 %	4.1 %
>180	3.7 %	3.9 %	3.6 %	3.8 %
<b>Total</b>	<b>4.9 %</b>	<b>4.5 %</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	9 al 13 de octubre				16 al 20 de octubre				23 al 27 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	15	129	5273	4980	15	146	3402	3435	13	135	4310	3979
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1967	1554	0	0	1402	945	0	0	1915	1346
<b>Otros</b>	129	15	1181	1887	146	15	1023	1446	135	13	883	1784
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>8421</b>	<b>8421</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>5826</b>	<b>5826</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>7109</b>	<b>7109</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.