

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2017

Fecha de Información: 19 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\$1702.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.1%.<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	380.1	173.7	39.7	168.0	29.9	108.0	104.1
15-35	652.8	661.1	183.5	112.3	216.6	279.5	261.0
36-60	0.2	20.3	0.0	0.0	20.3	0.2	0.0
61-90	2.1	16.8	0.2	0.0	16.6	2.1	0.0
91-180	69.1	92.2	40.2	20.0	27.0	24.1	25.0
>180	18.5	5.2	0.0	0.0	5.2	18.5	0.0
<b>Total</b>	<b>1122.8</b>	<b>969.2</b>	<b>263.5</b>	<b>300.3</b>	<b>315.6</b>	<b>432.4</b>	<b>390.1</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	4.0 %	4.8 %	4.0 %	4.1 %
15-35	4.1 %	4.3 %	4.0 %	4.2 %
36-60	-	4.5 %	3.0 %	4.4 %
61-90	-	4.4 %	3.8 %	4.3 %
91-180	3.9 %	4.1 %	3.9 %	4.0 %
>180	-	4.0 %	3.4 %	3.5 %
<b>Total</b>	<b>4.0 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.0 %</b>	<b>4.1 %</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	16 al 20 de octubre				23 al 27 de octubre				30 de oct. al 3 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	165	4286	3868	16	139	4982	4754	5	95	4074	3617
Intragruppo y off-shore***	0	0	1628	1548	0	0	2216	1543	0	0	1310	1083
Otros	165	22	991	1489	139	16	942	1843	95	5	1052	1736
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>6905</b>	<b>6905</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>8140</b>	<b>8140</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>6436</b>	<b>6436</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.