

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.