

Fecha de Publicación: 24 de octubre de 2017

Fecha de Información: 20 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\$1374.8 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	107.3	209.6	146.5	52.5	22.0	13.8	41.0
15-35	559.7	399.4	98.0	208.5	121.9	171.7	179.5
36-60	65.3	69.6	0.0	0.0	69.6	65.3	0.0
61-90	1.1	47.1	40.0	0.0	7.1	1.1	0.0
91-180	40.1	18.4	0.0	0.0	18.4	40.1	0.0
>180	40.1	52.7	35.0	25.0	2.7	0.1	15.0
<b>Total</b>	<b>813.6</b>	<b>796.7</b>	<b>319.5</b>	<b>286.0</b>	<b>241.6</b>	<b>292.1</b>	<b>235.5</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.2 %	4.1 %	3.9 %	4.0 %
15-35	4.5 %	4.1 %	4.0 %	4.2 %
36-60	-	4.3 %	4.2 %	4.3 %
61-90	-	4.1 %	3.8 %	4.1 %
91-180	-	4.1 %	3.7 %	3.9 %
>180	3.5 %	3.5 %	3.5 %	3.5 %
<b>Total</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.1 %</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	19	138	5065	4903	7	95	4097	3677
Intragruppo y off-shore***	0	0	1628	1548	0	0	2333	1593	0	0	1339	1086
Otros	165	22	991	1489	138	19	943	1846	95	7	1073	1745
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>6905</b>	<b>6905</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>8342</b>	<b>8342</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>6509</b>	<b>6509</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) <sup>Δ</sup> (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.