

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2017

Fecha de Información: 27 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\$1241.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.<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	230.1	165.6	39.0	41.0	18.3	80.8	108.3
15-35	515.1	497.2	211.5	179.8	101.4	151.1	184.3
36-60	12.1	18.3	5.0	0.8	8.3	6.3	5.0
61-90	4.7	2.3	0.0	0.0	2.3	4.7	0.0
91-180	73.4	6.9	0.0	1.8	6.9	71.6	0.0
>180	5.4	8.4	0.0	0.0	8.4	5.4	0.0
<b>Total</b>	<b>840.8</b>	<b>698.7</b>	<b>255.5</b>	<b>223.3</b>	<b>145.6</b>	<b>319.9</b>	<b>297.6</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	3.7 %	2.7 %	3.7 %	3.5 %
15-35	3.9 %	4.1 %	3.8 %	3.9 %
36-60	3.9 %	4.0 %	3.3 %	3.8 %
61-90	-	4.8 %	3.4 %	3.9 %
91-180	-	3.9 %	3.5 %	3.5 %
>180	-	4.4 %	3.2 %	3.9 %
<b>Total</b>	<b>3.8 %</b>	<b>3.9 %</b>	<b>3.7 %</b>	<b>3.8 %</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	23 al 27 de octubre				30 de oct. al 3 de noviembre				6 al 10 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	139	5676	5339	35	98	4587	4072	35	103	3683	4188
Intragruppo y off-shore***	0	0	2574	2022	0	0	1421	1181	0	0	1757	636
Otros	139	28	989	1878	98	35	1113	1867	103	35	992	1608
<b>Total</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>9239</b>	<b>9239</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>7121</b>	<b>7121</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>6432</b>	<b>6432</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 intragruppo.